

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de octubre de 2021
Fecha de Información: 01 de octubre de 2021¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2241 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.48%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	253,3	233,8	81,4	154,4	71,3	17,8	81,1
15-35	744,4	645,5	283,1	420,5	79,1	40,6	283,3
36-60	23,4	52,2	8,1	0,0	44,1	23,4	0,0
61-90	286,1	337,1	25,0	0,0	62,1	36,1	250,0
91-180	114,4	161,2	0,0	10,0	61,2	4,4	100,0
>180	73,2	66,1	21,0	35,0	10,1	3,2	35,0
Total	1494,8	1495,9	418,7	619,9	327,9	125,5	749,4

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.38%	2.48%	2.24%	2.35%
15-35	2.37%	2.46%	2.38%	2.40%
36-60	—	2.61%	2.33%	2.52%
61-90	2.45%	2.58%	2.35%	2.47%
91-180	2.86%	2.80%	2.46%	2.80%
>180	2.93%	3.49%	2.97%	3.13%
Total	2.49%	2.57%	2.36%	2.48%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	27 sep. - 01 oct.				04 - 08 oct.				11 - 15 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	8	15	398	446	54	115	6349	6740	46	125	4175	4362
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	221	106	0	0	3415	3136	0	0	2571	1826
Otros ^c	15	8	24	85	115	54	1166	939	125	46	649	1016
Total	23	23	643	637	169	169	10930	10815	171	171	7395	7204

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.