

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de octubre de 2021
Fecha de Información: 04 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\$1556 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.27%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	158,2	359,1	302,6	107,1	51,5	46,1	5
15-35	550,4	425,5	101,4	334,4	137,1	29,0	187
36-60	36,7	33,5	0,0	18,5	18,5	3,2	15
61-90	72,0	23,7	0,0	0,0	23,7	72,0	0
91-180	38,6	37,0	0,0	20,0	22,0	3,6	15
>180	18,0	25,5	0,0	15,0	25,5	3,0	0
Total	874,0	904,3	404,0	495,0	278,3	157,0	222

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	2.44%		2.02%	1.43%	1.78%
15-35	2.31%		2.39%	2.28%	2.33%
36-60	2.40%		2.59%	2.41%	2.47%
61-90	—		2.62%	2.38%	2.44%
91-180	2.47%		2.82%	2.46%	2.62%
>180	—		3.27%	2.91%	3.12%
Total	2.33%		2.37%	2.14%	2.27%

^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	04 - 08 oct.				11 - 15 oct.				18 - 22 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	53	116	6554	7078	49	129	4187	4475	27	152	3104	3372
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3713	3299	0	0	2668	1829	0	0	1471	895
Otros ^c	116	53	1200	975	129	49	660	1020	152	27	661	958
Total	169	169	11467	11352	178	178	7515	7324	179	179	5236	5225

^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.