

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de octubre de 2021
Fecha de Información: 05 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\$2848 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.32%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	718,2	484,1	220,9	354,0	39,2	140,2	224,0
15-35	760,4	638,0	326,8	459,7	73,8	63,2	237,5
36-60	64,3	60,8	10,0	0,0	10,8	24,3	40,0
61-90	11,5	171,3	3,3	1,5	168,0	10,0	0,0
91-180	173,9	69,6	20,0	140,0	19,6	3,9	30,0
>180	125,2	182,5	80,0	20,0	22,5	25,2	80,0
Total	1853,5	1606,2	660,9	975,2	333,8	266,7	611,5

^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	2.37%		1.42%	2.00%	1.99%
15-35	2.26%		2.35%	2.27%	2.30%
36-60	2.43%		2.66%	2.33%	2.43%
61-90	—		2.45%	2.32%	2.44%
91-180	2.52%		2.69%	2.45%	2.51%
>180	3.32%		3.26%	4.08%	3.42%
Total	2.47%		2.31%	2.22%	2.32%

^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.

¹A 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.

²El 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	37	107	6461	6620	49	134	4451	4702	27	154	3145	3384
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3513	3326	0	0	2717	1901	0	0	1480	923
Otros ^c	107	37	1068	1000	134	49	689	1062	154	27	664	970
Total	144	144	11042	10946	183	183	7857	7665	181	181	5289	5277

^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.