

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de octubre de 2021
Fecha de Información: 06 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\$2852 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.28%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	703,7	483,6	255,1	488,0	30,1	17,2	198,5
15-35	860,6	963,0	549,2	483,6	55,5	18,8	358,3
36-60	0,3	23,4	0,0	0,0	23,4	0,3	0,0
61-90	94,6	85,5	7,1	11,3	28,4	33,3	50,0
91-180	78,4	156,0	56,6	20,0	49,4	8,4	50,0
>180	15,9	53,9	40,0	0,0	3,9	5,9	10,0
Total	1753,6	1765,3	908,0	1002,9	190,5	83,9	666,8

^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%		0.97%	2.26%	2.02%
15-35	2.32%		2.34%	2.27%	2.32%
36-60	—		2.28%	1.75%	2.27%
61-90	2.43%		2.52%	2.39%	2.44%
91-180	2.46%		2.67%	2.58%	2.58%
>180	3.35%		2.99%	3.22%	3.07%
Total	2.37%		2.18%	2.30%	2.28%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1)$. 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	29	85	4936	4814	50	137	4731	4932	27	154	3166	3424
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2531	2518	0	0	2796	2049	0	0	1502	923
Otros ^c	85	29	746	779	137	50	711	1065	154	27	670	980
Total	114	114	8213	8111	187	187	8238	8046	181	181	5338	5327

^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.