

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2021
Fecha de Información: 07 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\$2573 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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	295,4	180,5	98,1	216,6	19,4	15,8	63
15-35	599,9	840,3	617,6	317,6	37,8	97,3	185
36-60	26,2	45,1	7,9	0,3	37,3	26,0	0
61-90	83,5	82,4	20,4	19,6	42,0	43,9	20
91-180	459,6	81,4	0,0	426,0	51,4	3,6	30
>180	91,1	145,9	40,0	25,0	45,9	6,1	60
Total	1555,8	1375,7	783,9	1005,0	233,7	192,7	358

^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	2.31%	2.37%	2.14%	2.23%
15-35	2.29%	2.43%	2.27%	2.32%
36-60	—	2.67%	2.41%	2.57%
61-90	2.41%	2.56%	2.32%	2.43%
91-180	2.52%	2.84%	2.62%	2.69%
>180	3.60%	3.60%	3.63%	3.60%
Total	2.54%	2.67%	2.31%	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	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	19	47	3398	3345	50	141	4833	4985	25	156	3245	3469
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2018	1987	0	0	2834	2139	0	0	1502	943
Otros ^c	47	19	387	390	141	50	720	1070	156	25	674	987
Total	66	66	5803	5722	191	191	8387	8194	181	181	5421	5399

^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.