

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2021
Fecha de Información: 08 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\$1376 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.17%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	207,9	237,9	146,8	73,6	19,5	62,7	71,6
15-35	510,4	406,7	124,3	277,9	70,2	20,3	212,2
36-60	28,6	19,3	0,0	0,0	19,3	28,6	0,0
61-90	24,5	42,2	10,9	13,5	21,3	0,9	10,0
91-180	67,6	67,3	0,0	50,0	59,8	10,1	7,5
>180	42,1	43,1	20,6	20,1	2,5	2,0	20,0
Total	881,1	816,5	302,6	435,2	192,5	124,6	321,3

^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	2.15%		1.52%	1.54%	1.70%
15-35	2.20%		2.23%	2.09%	2.17%
36-60	—		2.61%	2.31%	2.43%
61-90	2.33%		2.68%	2.26%	2.56%
91-180	2.32%		2.79%	2.55%	2.71%
>180	3.56%		3.35%	3.75%	3.55%
Total	2.28%		2.26%	2.00%	2.17%

^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	5	27	951	1067	49	144	4945	5122	25	156	3452	3659
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	652	482	0	0	2955	2166	0	0	1502	968
Otros ^c	27	5	84	105	144	49	726	1129	156	25	683	989
Total	32	32	1687	1654	193	193	8626	8417	181	181	5637	5616

^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.