INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de octubre de 2021
Fecha de Información: 30 de septiembre de 2021[1]

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$2502 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.51%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	592,8	366,5	100,0	414,9	107,5	18,9	159,0
15-35	725,1	668,5	434,8	368,5	68,1	191,1	165,6
36-60	21,1	35,0	0,0	18,0	35,0	3,1	0,0
61-90	119,1	135,6	10,0	0,0	85,6	79,1	40,0
91-180	49,8	45,9	0,0	0,0	25,9	29,8	20,0
>180	70,6	127,0	35,0	0,0	22,0	0,6	70,0
Total	**1578,6**	**1378,4**	**579,8**	**801,3**	**344,0**	**322,7**	**454,6**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	2.12%	2.52%	2.51%	2.41%
15-35	2.46%	2.47%	2.47%	2.47%
36-60	–	2.63%	1.90%	2.57%
61-90	2.39%	2.69%	2.37%	2.51%
91-180	2.44%	2.95%	2.61%	2.68%
>180	3.48%	3.20%	3.63%	3.36%
Total	**2.49%**	**2.57%**	**2.47%**	**2.51%**

[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

	27 sep. - 01 oct.				04 - 08 oct.				11 - 15 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	14	73	2303	2534	53	109	6146	6558	42	121	4168	4348
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1608	1332	0	0	3329	2992	0	0	2567	1826
Otros[c]	73	14	284	305	109	53	1114	932	121	42	640	1009
Total	**87**	**87**	**4195**	**4171**	**162**	**162**	**10589**	**10482**	**163**	**163**	**7375**	**7183**

[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.