INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2021
Fecha de Información: 11 de octubre 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$710 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.31%[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	301,0	202,9	0	92,5	11,4	17,0	191,5
15-35	249,1	218,4	17	46,0	6,9	8,6	194,5
36-60	4,7	19,2	0	0,0	19,2	4,7	0,0
61-90	4,7	8,3	0	0,0	8,3	4,7	0,0
91-180	1,9	35,1	0	0,0	35,1	1,9	0,0
>180	6,0	45,1	0	0,0	45,1	6,0	0,0
Total	**567,4**	**529,0**	**17**	**138,5**	**126,0**	**42,9**	**386,0**

[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	2.13%	3.04%	1.89%	2.10%
15-35	2.16%	2.13%	1.98%	2.12%
36-60	–	2.45%	2.07%	2.37%
61-90	–	2.72%	2.07%	2.48%
91-180	–	2.75%	2.45%	2.74%
>180	–	4.07%	3.39%	3.99%
Total	**2.14%**	**3.04%**	**2.01%**	**2.31%**

[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

	11 – 15 oct.				18 - 22 oct.				25 - 29 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	55	149	5101	5147	30	160	3497	3686	35	174	4259	5047
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2955	2299	0	0	1508	990	0	0	2547	1418
Otros[c]	149	55	729	1132	160	30	684	990	174	35	1230	1492
Total	**204**	**204**	**8785**	**8578**	**190**	**190**	**5689**	**5666**	**209**	**209**	**8036**	**7957**

[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.