

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2021
Fecha de Información: 15 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\$2268 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.90%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	399,1	349,4	11,8	183,2	187,6	66,0	150,0
15-35	707,5	626,5	262,8	341,5	90,2	92,5	273,4
36-60	189,7	54,4	25,0	0,0	29,4	189,7	0,0
61-90	50,0	17,5	0,0	0,0	5,2	37,7	12,3
91-180	47,6	233,0	200,0	42,0	33,0	5,6	0,0
>180	21,1	7,5	0,0	0,0	7,5	21,1	0,0
Total	1415,0	1288,3	499,6	566,7	352,9	412,6	435,7

^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	1.47%	2.01%	1.14%	1.55%
15-35	1.92%	1.98%	1.87%	1.93%
36-60	—	2.32%	2.12%	2.14%
61-90	2.19%	2.35%	2.14%	2.17%
91-180	—	2.66%	2.32%	2.48%
>180	—	3.46%	3.63%	3.59%
Total	1.77%	2.08%	1.83%	1.90%

^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	11 – 15 oct.				18 - 22 oct.				25 - 29 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	8	49	1833	1892	38	163	4059	4119	39	185	4851	5740
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	772	694	1	0	1710	1279	0	0	2691	1812
Otros ^c	49	8	627	628	162	38	728	1077	185	39	1619	1528
Total	57	57	3232	3214	201	201	6497	6475	224	224	9161	9080

^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.