

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2021
Fecha de Información: 12 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\$2352 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.03%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	565,7	357,5	295,7	528,9	41,3	16,3	20,5
15-35	450,3	535,0	342,8	272,0	48,7	34,8	143,5
36-60	60,5	112,1	26,6	2,9	40,5	12,5	45,0
61-90	108,0	44,1	0,0	4,0	42,8	102,7	1,2
91-180	157,6	136,1	7,5	126,9	121,1	23,2	7,5
>180	14,1	40,1	13,3	0,0	15,3	2,6	11,5
Total	1356,1	1224,8	685,9	934,7	309,7	192,2	229,2

^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	1.15%		2.03%	1.69%	1.77%
15-35	1.97%		1.99%	1.93%	1.97%
36-60	2.16%		2.43%	1.90%	2.24%
61-90	2.23%		2.54%	2.09%	2.22%
91-180	2.30%		2.77%	2.49%	2.69%
>180	2.96%		3.14%	3.10%	3.06%
Total	1.99%		2.21%	1.86%	2.03%

^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	56	147	5515	5263	28	163	3532	3860	35	178	4434	5229
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3053	2688	0	0	1661	1022	0	0	2611	1485
Otros ^c	147	56	728	1135	163	28	705	994	178	35	1245	1495
Total	203	203	9296	9086	191	191	5898	5876	213	213	8290	8209

^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.