

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2021
Fecha de Información: 13 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\$4159 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.93%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	328,6	593,1	135,4	255,2	414,2	29,9	43,5
15-35	687,1	858,8	560,3	409,1	48,1	27,5	250,5
36-60	13,5	61,6	46,5	0,0	15,1	13,5	0,0
61-90	216,4	462,1	327,9	100,0	24,2	6,4	110,0
91-180	942,5	148,2	0,0	502,2	108,2	400,3	40,0
>180	131,8	170,3	135,5	120,0	23,3	0,3	11,5
Total	2320,1	2294,1	1205,6	1386,6	633,0	478,0	455,5

^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	1.96%		1.26%	1.74%	1.45%
15-35	1.95%		1.94%	1.42%	1.79%
36-60	—		2.38%	1.92%	2.16%
61-90	2.18%		2.46%	2.17%	2.22%
91-180	2.51%		2.79%	2.54%	2.59%
>180	2.92%		3.38%	3.54%	3.23%
Total	2.08%		1.79%	2.01%	1.93%

^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	36	118	5013	5067	29	166	3594	3892	37	181	4578	5334
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2710	2447	0	0	1661	1054	0	0	2678	1568
Otros ^c	118	36	903	927	166	29	721	1009	181	37	1240	1514
Total	154	154	8626	8441	195	195	5976	5955	218	218	8496	8416

^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.