

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2021
Fecha de Información: 14 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\$3104 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.95%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	711,5	549,7	126,5	449,6	265,2	103,9	158
15-35	699,9	901,1	395,5	222,3	106,6	78,6	399
36-60	247,6	33,9	0,0	21,6	33,9	226,0	0
61-90	70,6	101,8	50,0	25,0	12,8	6,6	39
91-180	169,0	100,9	0,0	41,0	28,9	56,0	72
>180	166,1	83,3	0,0	0,0	19,3	102,1	64
Total	2064,8	1770,7	572,0	759,5	466,7	573,3	732

^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	1.49%		1.63%	1.63%	1.61%
15-35	1.92%		1.94%	1.85%	1.91%
36-60	-		2.29%	2.07%	2.10%
61-90	2.18%		2.26%	2.00%	2.20%
91-180	2.36%		2.65%	2.49%	2.46%
>180	2.99%		3.24%	3.27%	3.17%
Total	1.98%		1.89%	1.98%	1.95%

^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.

¹A 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.

²El 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

Sector	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	19	81	3724	3822	33	166	3770	3973	37	181	4773	5531
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1818	1657	0	0	1709	1191	0	0	2680	1753
Otros ^c	81	19	849	847	166	33	729	1023	181	37	1435	1524
Total	100	100	6391	6326	199	199	6208	6187	218	218	8888	8808

^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.