

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2021
Fecha de Información: 19 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\$2309 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.15%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	438,1	333,7	124,6	210,4	10,6	29,2	198,5
15-35	633,8	842,5	498,7	244,0	15,4	61,4	328,4
36-60	25,5	61,8	38,7	0,0	13,1	15,5	10,0
61-90	15,4	2,6	0,0	0,0	2,6	15,4	0,0
91-180	266,5	173,1	115,0	228,7	32,1	11,8	26,0
>180	41,4	78,7	20,0	0,0	17,7	0,4	41,0
Total	1420,8	1492,4	796,9	683,2	91,6	133,7	603,9

^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	2.72%		2.12%	1.69%	2.25%
15-35	2.02%		1.97%	1.94%	1.99%
36-60	2.19%		2.26%	1.94%	2.11%
61-90	—		2.44%	2.10%	2.15%
91-180	2.37%		2.47%	2.44%	2.43%
>180	2.87%		3.59%	3.63%	3.09%
Total	2.33%		2.12%	1.85%	2.15%

^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: ((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

Sectores	18 – 22 oct.				25 - 29 oct.				01 - 05 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	165	4306	4264	40	185	5046	5935	26	109	4024	3670
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	1788	1440	0	0	2767	1872	0	0	2059	2054
Otros ^c	165	44	728	1086	185	40	1626	1537	109	26	463	777
Total	210	209	6822	6790	225	225	9439	9344	135	135	6546	6501

^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.