

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2021
Fecha de Información: 20 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\$2536 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.00%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	517,2	477,6	119,3	322,8	183,3	19,4	175
15-35	537,4	1018,4	594,5	99,0	44,9	59,4	379
36-60	43,2	25,7	5,0	0,0	20,7	43,2	0
61-90	11,9	13,8	0,0	0,0	3,8	1,9	10
91-180	170,9	66,6	0,0	70,0	36,6	70,9	30
>180	211,2	62,3	30,0	10,0	6,3	175,2	26
Total	1491,8	1664,4	748,8	501,9	295,6	370,0	620

^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	1.98%	0.81%	2.50%	1.53%
15-35	2.02%	1.94%	1.75%	1.95%
36-60	—	2.20%	1.99%	2.06%
61-90	2.18%	2.26%	2.20%	2.20%
91-180	2.43%	2.67%	2.47%	2.51%
>180	3.06%	2.76%	3.11%	3.05%
Total	2.07%	1.68%	2.28%	2.00%

^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	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	35	134	3438	3482	41	187	5252	6116	26	112	4048	3761
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	1460	1249	0	0	2844	2027	0	0	2137	2054
Otros ^c	133	35	678	815	187	41	1684	1542	112	26	464	791
Total	169	169	5576	5546	228	228	9780	9685	138	138	6649	6606

^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.