

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2021
Fecha de Información: 21 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\$2358 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.16%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	368,7	265,1	171,0	242,6	12,8	44,8	81,2
15-35	702,4	1142,2	647,3	205,8	66,6	68,4	428,3
36-60	16,1	36,2	14,0	10,0	22,2	6,1	0,0
61-90	98,6	121,6	0,0	0,0	25,6	2,6	96,0
91-180	149,0	50,9	10,0	50,0	20,9	79,0	20,0
>180	18,2	15,7	10,0	10,9	4,7	6,3	1,0
Total	1352,9	1631,6	852,4	519,3	152,7	207,1	626,5

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.03%	2.19%	1.95%	2.06%
15-35	2.06%	2.12%	2.08%	2.09%
36-60	—	2.27%	1.83%	2.17%
61-90	2.40%	2.53%	1.90%	2.41%
91-180	2.54%	2.68%	2.43%	2.49%
>180	3.75%	3.34%	2.89%	3.02%
Total	2.13%	2.20%	2.15%	2.16%

^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	21	70	2434	2596	44	185	5340	6289	26	111	4148	3911
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1121	1032	0	0	2966	2065	0	0	2187	2074
Otros ^c	70	21	572	473	185	44	1692	1549	111	26	496	802
Total	91	91	4127	4101	229	229	9998	9903	137	137	6831	6787

^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.