

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2021
Fecha de Información: 22 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\$2389 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.13%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	59,4	214,6	83,0	32,4	116,6	12,0	15
15-35	371,1	864,8	690,1	168,0	14,7	43,1	160
36-60	1,1	20,0	8,8	0,0	11,2	1,1	0
61-90	11,5	55,4	40,0	0,0	5,4	1,5	10
91-180	611,1	122,3	0,0	395,0	32,3	126,1	90
>180	301,3	199,2	25,0	128,0	6,2	5,3	168
Total	1355,5	1476,3	846,9	723,4	186,4	189,1	443

^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	2.18%	0.38%	1.58%	0.72%
15-35	2.25%	1.55%	2.14%	1.77%
36-60	—	2.36%	2.05%	2.34%
61-90	2.28%	2.37%	2.18%	2.35%
91-180	2.47%	2.62%	2.26%	2.31%
>180	3.45%	3.72%	3.46%	3.48%
Total	2.75%	1.55%	2.40%	2.13%

^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	11	34	605	591	49	191	5444	6503	27	111	4151	3960
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	147	221	0	0	3033	2134	0	0	2230	2074
Otros ^c	34	11	233	157	191	49	1809	1555	111	27	497	801
Total	45	45	985	969	240	240	10286	10192	138	138	6878	6835

^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.