

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2021
Fecha de Información: 25 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\$3074 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.91%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	628,5	498,2	160,8	378,6	291,2	203,7	46,2
15-35	307,5	693,0	559,8	144,4	17,2	47,1	116,0
36-60	9,4	130,4	99,1	1,5	31,4	7,9	0,0
61-90	27,4	13,2	0,0	25,0	13,2	2,4	0,0
91-180	355,6	325,4	76,2	236,3	248,2	118,3	1,0
>180	216,9	42,6	20,0	10,0	11,6	195,9	11,0
Total	1545,2	1702,9	915,9	795,7	612,8	575,3	174,2

^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	2.31%		0.99%	1.16%	1.14%
15-35	2.29%		2.32%	1.58%	2.10%
36-60	—		1.58%	1.94%	1.61%
61-90	—		2.50%	2.29%	2.47%
91-180	2.30%		2.63%	2.37%	2.52%
>180	2.90%		3.48%	3.36%	3.35%
Total	2.33%		1.86%	1.89%	1.91%

^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	25 - 29 oct.				01 - 05 nov.				08 - 12 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	55	193	5989	6886	26	111	4197	3994	44	151	3569	3492
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3132	2473	0	0	2258	2105	0	0	1872	1292
Otros ^c	192	55	2072	1740	111	26	498	810	151	44	436	1002
Total	247	248	11193	11099	137	137	6953	6909	195	195	5877	5786

^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.