

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2021
Fecha de Información: 26 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\$1941 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.35%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	571,8	312,0	204,2	450,5	7,7	21,2	100,0
15-35	218,1	565,8	411,6	41,8	27,1	49,2	127,1
36-60	32,2	134,4	60,0	1,1	49,4	6,0	25,0
61-90	38,0	79,2	71,4	30,0	7,8	8,0	0,0
91-180	147,4	91,2	0,0	50,0	8,2	14,4	83,0
>180	68,0	83,3	15,4	0,1	2,9	3,0	64,9
Total	1075,3	1265,9	762,7	573,5	103,2	101,7	400,0

^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	2.39%		2.34%	9.84%	2.12%
15-35	2.40%		2.31%	2.32%	2.33%
36-60	2.45%		2.33%	2.11%	2.35%
61-90	—		2.49%	2.38%	2.44%
91-180	2.62%		2.64%	2.47%	2.56%
>180	3.35%		3.40%	3.25%	3.35%
Total	2.60%		2.35%	2.10%	2.35%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1)$. 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	42	167	5437	5687	31	111	4240	4072	49	151	3629	3627
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2607	2416	0	0	2315	2126	0	0	1964	1294
Otros ^c	166	42	1654	1503	111	31	498	812	151	49	439	1020
Total	208	209	9698	9606	142	142	7053	7010	200	200	6032	5941

^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.