

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2021
Fecha de Información: 27 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\$3527 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.31%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	510,8	255,4	207,6	366,4	10,8	107,4	37,0
15-35	553,1	609,5	328,5	335,4	101,1	37,8	179,9
36-60	46,4	179,1	85,0	7,3	58,1	3,1	36,0
61-90	505,1	32,1	0,0	472,0	16,4	17,4	15,7
91-180	280,5	587,8	440,0	175,0	44,8	2,5	103,0
>180	86,8	295,5	245,0	40,0	7,5	3,8	43,0
Total	1982,7	1959,3	1306,2	1396,1	238,5	172,1	414,6

^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	2.56%		2.16%	1.70%	1.83%
15-35	2.42%		2.43%	1.83%	2.24%
36-60	2.40%		2.47%	2.49%	2.45%
61-90	2.42%		2.73%	2.41%	2.47%
91-180	2.75%		2.77%	2.71%	2.75%
>180	3.87%		3.84%	3.78%	3.84%
Total	2.66%		2.55%	1.90%	2.31%

^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	36	154	4433	4647	81	113	4287	4262	50	153	3665	3661
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2192	2029	0	0	2499	2167	0	0	1964	1297
Otros ^c	154	36	1283	1141	113	81	500	813	153	50	447	1028
Total	190	190	7908	7817	194	194	7286	7242	203	203	6076	5986

^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.