

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 28 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\$3317 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.56%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	259,8	418,4	251,6	131,6	107,8	69,2	59,0
15-35	470,4	615,5	406,7	221,7	65,3	105,2	143,5
36-60	109,4	31,4	13,9	37,3	17,6	72,1	0,0
61-90	687,9	36,7	0,0	653,0	11,7	9,9	25,0
91-180	90,2	699,5	600,0	40,0	74,5	25,2	25,0
>180	114,0	94,4	30,4	50,0	6,0	6,0	58,0
Total	1731,8	1896,0	1302,6	1133,6	283,0	287,7	310,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	2.43%		2.42%	1.93%	2.29%
15-35	2.53%		2.54%	2.37%	2.48%
36-60	—		2.51%	2.47%	2.48%
61-90	2.49%		2.83%	2.46%	2.51%
91-180	2.56%		2.87%	2.50%	2.69%
>180	3.73%		3.62%	3.89%	3.79%
Total	2.74%		2.56%	2.46%	2.56%

^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	37	100	2157	2241	82	116	4335	4381	51	153	3695	3850
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1087	1026	0	0	2592	2173	0	0	2050	1315
Otros ^c	100	37	655	595	116	82	498	819	153	51	551	1041
Total	137	137	3899	3862	198	198	7425	7373	204	204	6296	6206

^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.