

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 29 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\$1955 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.67%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	75,6	442,9	253,7	13,0	143,2	16,6	46,0
15-35	462,3	556,3	357,1	242,7	93,2	113,6	106,0
36-60	132,3	25,1	9,1	41,3	16,0	91,0	0,0
61-90	84,4	57,2	3,9	37,5	17,2	10,9	36,0
91-180	199,2	104,2	0,0	98,0	37,7	34,7	66,5
>180	48,2	49,3	20,0	10,0	1,3	10,2	28,0
Total	1002,1	1235,0	643,9	442,6	308,7	277,1	282,5

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.73%	2.59%	2.23%	2.58%
15-35	2.66%	2.71%	2.39%	2.61%
36-60	—	2.89%	2.61%	2.65%
61-90	2.63%	2.69%	2.50%	2.62%
91-180	2.85%	2.78%	2.66%	2.74%
>180	3.56%	2.69%	3.82%	3.48%
Total	2.80%	2.68%	2.57%	2.67%

^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	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	25	55	868	932	83	120	4407	4587	52	154	3725	4101
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	331	284	0	0	2784	2233	0	0	2157	1316
Otros ^c	55	25	346	317	120	83	507	824	154	52	685	1049
Total	80	80	1545	1533	203	203	7698	7644	206	206	6567	6466

^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.