

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de noviembre de 2021

Fecha de Información: 02 de noviembre 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\$1755 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.66%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	225,6	244,6	173,0	178,6	56,9	32,3	14,7
15-35	398,5	715,8	327,6	100,5	217,4	127,3	170,7
36-60	40,7	42,3	10,5	10,0	3,8	2,7	28,0
61-90	16,8	22,1	11,9	0,0	7,6	14,3	2,6
91-180	191,7	39,8	10,0	20,0	14,8	156,7	15,0
>180	20,0	33,9	27,0	10,0	0,9	4,0	6,0
Total	893,3	1098,5	560,0	319,1	301,5	337,2	237,0

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.80%	2.30%	1.62%	2.04%
15-35	2.88%	2.87%	2.72%	2.84%
36-60	2.74%	3.00%	2.45%	2.75%
61-90	2.40%	2.91%	2.67%	2.78%
91-180	2.82%	2.88%	2.75%	2.76%
>180	3.54%	4.39%	3.67%	3.93%
Total	2.86%	2.74%	2.43%	2.66%

^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	01 – 05 nov.				08 - 12 nov.				15 - 19 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	91	121	4530	4706	60	155	3742	4171	24	153	3958	4015
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2898	2361	0	0	2167	1316	0	0	1810	1234
Otros ^c	121	91	512	819	155	60	735	1056	153	24	735	1167
Total	212	212	7940	7886	215	215	6644	6543	177	177	6503	6416

^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.