

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de noviembre de 2021**

**Fecha de Información: 03 de noviembre de 2021<sup>1</sup>**

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\$2374 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.99%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	223,8	465,8	312,5	106,0	111,3	75,8	42,0
15-35	457,1	983,8	598,8	125,7	130,6	77,0	254,5
36-60	26,1	5,3	0,0	1,5	3,3	22,6	2,0
61-90	252,2	21,3	0,0	10,0	6,3	227,2	15,0
91-180	135,7	57,2	15,0	90,5	26,2	29,3	16,0
>180	74,1	26,2	0,0	36,2	1,2	12,9	25,0
<b>Total</b>	<b>1169,1</b>	<b>1559,5</b>	<b>926,2</b>	<b>369,8</b>	<b>278,9</b>	<b>444,8</b>	<b>354,5</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.04%	2.82%	2.88%	2.86%
15-35	3.11%	3.09%	2.93%	3.07%
36-60	2.89%	3.10%	2.67%	2.74%
61-90	2.86%	3.02%	2.85%	2.86%
91-180	2.91%	3.09%	2.86%	2.92%
>180	3.30%	4.04%	3.26%	3.28%
<b>Total</b>	<b>3.09%</b>	<b>3.02%</b>	<b>2.90%</b>	<b>2.99%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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 <sup>a</sup>	80	89	3848	4167	69	158	3749	4200	27	152	4089	4225
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2622	1920	0	0	2191	1316	0	0	1864	1259
Otros <sup>c</sup>	89	80	381	714	158	69	733	1055	152	27	844	1226
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>6851</b>	<b>6801</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>6673</b>	<b>6571</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>6797</b>	<b>6710</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.