

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 05 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\$1799 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.58%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	207,2	204,4	110,2	86,2	43,2	70,0	51,0
15-35	304,3	673,0	463,5	121,7	63,5	36,7	146,0
36-60	40,8	9,2	0,2	26,2	5,6	11,3	3,4
61-90	165,6	95,9	25,0	65,0	5,9	35,6	65,0
91-180	227,2	137,1	0,0	95,0	42,1	37,2	95,0
>180	67,4	58,0	26,6	0,4	0,7	36,2	30,8
Total	1012,5	1177,6	625,5	394,5	161,0	226,9	391,2

^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	3.71%		4.01%	2.92%	3.48%
15-35	3.71%		3.84%	3.61%	3.77%
36-60	3.50%		3.66%	3.35%	3.46%
61-90	3.39%		3.39%	2.99%	3.21%
91-180	3.22%		3.50%	3.25%	3.28%
>180	4.17%		4.54%	4.09%	4.14%
Total	3.57%		3.83%	3.27%	3.58%

^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	8	39	408	458	72	159	3963	4599	32	155	4256	4387
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	283	209	0	0	2513	1409	0	0	1898	1276
Otros ^c	39	8	69	94	159	72	765	1119	155	32	912	1314
Total	47	47	760	761	231	231	7241	7127	187	187	7066	6977

^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.