

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2021**  
**Fecha de Información: 09 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\$3345 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.29%<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	1196,8	912,7	226,8	430,6	71,4	151,6	614,5
15-35	664,5	844,2	554,1	306,5	6,6	74,4	283,5
36-60	12,8	79,0	73,5	10,0	5,5	2,8	0,0
61-90	28,2	71,8	0,0	0,0	71,3	27,7	0,5
91-180	316,1	176,9	0,0	84,0	15,4	70,5	161,5
>180	55,7	73,0	45,0	0,0	1,5	29,2	26,5
<b>Total</b>	<b>2274,1</b>	<b>2157,6</b>	<b>899,4</b>	<b>831,2</b>	<b>171,7</b>	<b>356,4</b>	<b>1086,5</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	3.31%	3.20%	3.34%	3.31%
15-35	3.30%	3.34%	3.18%	3.28%
36-60	—	3.30%	2.78%	3.12%
61-90	3.00%	3.06%	2.95%	3.03%
91-180	3.03%	3.31%	3.12%	3.08%
>180	4.05%	4.16%	3.87%	4.05%
<b>Total</b>	<b>3.28%</b>	<b>3.33%</b>	<b>3.26%</b>	<b>3.29%</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	08 – 12 nov.				15 - 19 nov.				22 - 26 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	51	130	4021	4223	39	152	4964	5226	60	161	4053	5630
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2405	1881	0	0	2064	1373	0	0	3074	998
Otros <sup>c</sup>	130	51	595	821	152	39	1130	1471	161	60	951	1386
<b>Total</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>7021</b>	<b>6925</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>8158</b>	<b>8070</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>8078</b>	<b>8014</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.