

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 09 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\$3345 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.29%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	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
Total	2274,1	2157,6	899,4	831,2	171,7	356,4	1086,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
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%
Total	3.28%		3.33%	3.26%	3.29%

^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	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 ^a	51	130	4021	4223	39	152	4964	5226	60	161	4053	5630
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2405	1881	0	0	2064	1373	0	0	3074	998
Otros ^c	130	51	595	821	152	39	1130	1471	161	60	951	1386
Total	181	181	7021	6925	191	191	8158	8070	221	221	8078	8014

^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.