

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 10 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\$3005 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.77%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	707,2	519,3	200,3	462,7	114,0	39,5	205,0
15-35	718,3	1056,5	697,4	313,8	33,5	79,1	325,5
36-60	1,9	9,6	1,0	0,0	8,6	1,9	0,0
61-90	49,7	87,9	45,0	23,1	24,7	8,4	18,2
91-180	196,0	163,3	100,0	50,0	23,3	106,0	40,0
>180	53,5	82,9	30,0	0,0	0,9	1,5	52,0
Total	1726,5	1919,4	1073,7	849,5	205,0	236,3	640,7

^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	3.09%	2.32%	2.04%	2.34%
15-35	3.07%	3.03%	2.84%	2.99%
36-60	—	3.01%	2.85%	2.98%
61-90	2.82%	3.09%	2.85%	2.97%
91-180	2.93%	2.70%	3.02%	2.89%
>180	4.16%	3.60%	3.48%	3.94%
Total	3.15%	2.83%	2.48%	2.77%

^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	38	106	2939	3095	40	149	5376	5493	62	162	4160	5818
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1757	1422	0	0	2151	1603	0	0	3106	1030
Otros ^c	106	38	455	565	149	40	1139	1483	162	62	1056	1406
Total	144	144	5151	5082	189	189	8666	8579	224	224	8322	8254

^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.