

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 11 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\$966 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.48%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	464,3	170,0	89,2	352,3	0,8	32,0	80
15-35	170,0	323,3	130,1	0,0	33,1	10,0	160
36-60	1,1	7,9	0,0	0,0	7,9	1,1	0
61-90	23,8	19,4	0,0	20,0	16,4	0,8	3
91-180	21,3	6,1	0,0	20,0	6,1	1,3	0
>180	0,1	1,3	0,0	0,0	1,3	0,1	0
Total	680,5	528,0	219,3	392,3	65,7	45,3	243

^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	2.76%	2.98%	1.70%	1.99%
15-35	2.99%	3.11%	2.82%	3.02%
36-60	—	3.19%	2.83%	3.15%
61-90	2.88%	2.69%	2.75%	2.72%
91-180	—	3.36%	2.89%	2.99%
>180	—	3.72%	3.15%	3.69%
Total	2.91%	3.07%	1.84%	2.48%

^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	21	74	582	555	42	150	5802	5687	62	161	4275	5908
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	240	328	0	0	2229	1913	0	0	3143	1096
Otros ^c	74	21	224	161	150	42	1140	1483	161	62	1058	1404
Total	95	95	1046	1044	192	192	9171	9083	223	223	8476	8408

^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.