

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 16 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\$3118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.53%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	322,2	371,6	211,9	108,6	99,8	153,6	60,0
15-35	718,4	1165,8	730,6	206,9	36,2	112,6	399,0
36-60	54,3	248,1	219,2	10,0	3,9	19,3	25,0
61-90	210,4	8,2	0,0	200,0	8,2	10,4	0,0
91-180	263,7	245,0	88,5	54,0	51,5	104,7	105,0
>180	66,6	47,9	25,0	45,1	7,8	6,4	15,1
Total	1635,6	2086,7	1275,2	624,5	207,3	407,0	604,1

^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	3.58%		3.66%	3.42%	3.55%
15-35	3.54%		3.69%	3.48%	3.60%
36-60	3.42%		3.34%	3.04%	3.23%
61-90	—		3.24%	2.97%	3.09%
91-180	3.27%		3.30%	3.15%	3.23%
>180	4.08%		3.55%	3.56%	3.72%
Total	3.51%		3.65%	3.37%	3.53%

^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.

¹A 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.

²El 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	15 – 19 nov.				22 - 26 nov.				29 nov. - 03 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	55	160	6239	6079	181	228	4390	6041	29	165	3695	4812
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2406	2179	0	0	3197	1182	0	0	2600	925
Otros ^c	160	55	1279	1578	228	181	1124	1419	165	29	589	1101
Total	215	215	9924	9836	409	409	8711	8642	194	194	6884	6838

^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.