

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 17 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\$2844 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.89%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	527,6	190,4	81,4	304,0	44,0	158,6	65,0
15-35	322,9	1437,8	1216,3	80,4	25,2	46,2	196,2
36-60	41,3	76,2	36,5	0,6	9,7	10,7	30,0
61-90	24,1	21,8	1,3	1,4	20,6	22,7	0,0
91-180	226,3	197,8	0,0	20,0	41,9	50,4	155,9
>180	210,1	55,3	0,0	150,0	14,8	19,6	40,5
Total	1352,2	1979,3	1335,5	556,4	156,2	308,2	487,6

^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	3.86%		3.95%	3.82%	3.85%
15-35	4.10%		4.10%	3.85%	4.08%
36-60	3.56%		3.39%	3.22%	3.43%
61-90	—		3.53%	3.08%	3.29%
91-180	3.60%		3.65%	3.41%	3.55%
>180	3.74%		4.17%	3.63%	3.69%
Total	3.84%		4.03%	3.71%	3.89%

^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	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	24	139	5559	5199	297	227	4433	6094	32	165	3827	4866
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2169	2149	0	0	3201	1198	0	0	2628	937
Otros ^c	139	24	991	1305	227	297	1157	1430	165	32	599	1196
Total	163	163	8719	8653	524	524	8791	8722	197	197	7054	6999

^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.