

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2021**  
**Fecha de Información: 19 de noviembre de 2021<sup>1</sup>**

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\$1838 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.42%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	514,7	439,8	168,5	187,5	53,3	109,2	218,0
15-35	335,0	478,8	302,6	108,4	29,1	79,6	147,0
36-60	3,9	41,3	35,4	0,0	4,4	2,4	1,5
61-90	99,5	103,4	29,8	0,0	30,6	56,5	43,0
91-180	81,2	136,9	50,0	0,0	14,5	8,8	72,4
>180	42,1	42,9	12,0	31,0	30,9	11,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1076,4</b>	<b>1243,0</b>	<b>598,3</b>	<b>326,8</b>	<b>162,8</b>	<b>267,7</b>	<b>481,9</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.70%		4.74%	3.49%	4.30%
15-35	4.83%		4.83%	4.78%	4.82%
36-60	4.06%		4.74%	3.94%	4.38%
61-90	3.98%		4.14%	3.84%	3.96%
91-180	3.82%		3.84%	3.57%	3.81%
>180	—		4.40%	4.04%	4.22%
<b>Total</b>	<b>4.54%</b>		<b>4.63%</b>	<b>4.03%</b>	<b>4.42%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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: ((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 <sup>a</sup>	11	46	811	693	336	230	4969	6496	46	168	4018	5157
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	333	320	0	0	3283	1494	0	0	2749	969
Otros <sup>c</sup>	46	11	101	232	230	336	1314	1508	168	46	654	1229
<b>Total</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>1245</b>	<b>1245</b>	<b>566</b>	<b>566</b>	<b>9566</b>	<b>9498</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>7421</b>	<b>7355</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.