

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 22 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\$3366 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.96%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	870,9	1050,3	454,7	675,1	420,6	20,8	175,0
15-35	351,7	730,8	558,1	150,5	18,2	46,7	154,5
36-60	348,0	56,8	1,3	0,0	20,5	313,0	35,0
61-90	5,9	5,3	0,0	0,0	5,3	5,9	0,0
91-180	116,6	154,9	30,0	2,9	69,9	58,7	55,0
>180	90,7	44,3	0,0	0,0	3,8	50,2	40,5
Total	1783,8	2042,4	1044,0	828,5	538,3	495,3	460,0

^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	4.81%	3.05%	4.11%	3.67%
15-35	4.79%	4.50%	4.54%	4.56%
36-60	4.03%	4.24%	3.97%	3.99%
61-90	—	4.19%	3.66%	3.91%
91-180	3.70%	3.84%	3.55%	3.72%
>180	4.34%	4.13%	3.72%	4.00%
Total	4.57%	3.67%	4.08%	3.96%

^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	22 – 26 nov.				29 nov. - 03 dic.				06 - 10 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	339	233	5536	7190	50	170	4185	5441	71	111	3117	4105
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3569	2001	0	0	2922	1091	0	0	2533	715
Otros ^c	233	339	1674	1519	170	50	725	1233	111	71	303	618
Total	572	572	10779	10710	220	220	7832	7765	182	182	5953	5438

^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.