

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2021

Fecha de Información: 23 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\$3581 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.31%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	790,1	848,5	395,5	610,9	304,9	31,2	148
15-35	585,2	1025,2	703,6	222,6	11,6	52,6	310
36-60	32,7	7,7	1,4	0,0	3,3	29,7	3
61-90	212,7	62,3	0,0	10,5	22,3	162,2	40
91-180	60,9	91,7	75,0	30,5	11,7	25,4	5
>180	195,0	195,0	169,2	0,2	5,8	174,8	20
Total	1876,6	2230,5	1344,8	874,7	359,7	475,9	526

^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	4.80%	4.73%	10.46%	6.62%
15-35	4.92%	4.74%	4.83%	4.81%
36-60	4.88%	4.60%	4.38%	4.44%
61-90	4.04%	4.14%	3.87%	3.92%
91-180	3.83%	3.79%	3.65%	3.74%
>180	4.37%	4.38%	4.25%	4.31%
Total	4.79%	4.62%	6.47%	5.31%

^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	297	143	5416	6345	56	170	4282	5812	73	111	3162	4397
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3515	2478	0	0	3071	1120	0	0	2662	716
Otros ^c	143	297	1171	1225	170	56	887	1242	111	73	438	624
Total	440	440	10102	10048	226	226	8240	8174	184	184	6262	5737

^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.