

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 24 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\$1949 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.47%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	285,9	235,0	122,7	226,2	63,7	11,2	48,5
15-35	453,1	680,4	506,3	253,3	20,1	45,8	154,0
36-60	48,1	107,8	15,0	0,1	56,8	12,0	36,0
61-90	76,4	56,1	30,0	0,0	11,1	61,4	15,0
91-180	100,9	115,5	40,0	50,0	45,5	20,8	30,1
>180	50,8	44,3	20,0	4,4	2,3	24,4	22,0
Total	1015,2	1239,2	734,1	534,0	199,5	175,6	305,6

^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	4.97%		3.28%	4.50%	3.80%
15-35	4.96%		5.09%	4.60%	4.87%
36-60	4.97%		4.64%	4.24%	4.70%
61-90	4.20%		3.89%	3.72%	3.83%
91-180	3.91%		3.94%	3.69%	3.88%
>180	4.55%		4.23%	4.08%	4.27%
Total	4.79%		4.39%	4.36%	4.47%

^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	290	120	3376	3816	58	172	4390	5983	73	112	3192	4449
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2036	1706	0	0	3131	1160	0	0	2682	713
Otros ^c	120	290	914	766	172	58	947	1259	112	73	444	627
Total	410	410	6326	6288	230	230	8468	8402	185	185	6318	5789

^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.