

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2021**  
**Fecha de Información: 25 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\$671 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.31%<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	219,3	160,8	17,0	60,0	0,8	16,3	143,0
15-35	219,1	288,6	89,8	35,0	16,8	2,1	182,0
36-60	30,7	37,2	23,8	23,9	8,4	1,8	5,0
61-90	7,2	13,1	0,0	0,0	10,9	5,0	2,2
91-180	1,9	9,9	0,0	0,0	9,9	1,9	0,0
>180	11,7	3,4	0,0	0,0	3,4	11,7	0,0
<b>Total</b>	<b>489,9</b>	<b>513,0</b>	<b>130,6</b>	<b>118,9</b>	<b>50,3</b>	<b>38,9</b>	<b>332,2</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	3.95%		4.79%	2.92%	3.67%
15-35	4.74%		4.93%	4.76%	4.80%
36-60	4.46%		4.55%	4.52%	4.52%
61-90	4.10%		4.22%	3.84%	4.10%
91-180	—		4.12%	3.40%	4.01%
>180	—		4.27%	3.97%	4.04%
<b>Total</b>	<b>4.39%</b>		<b>4.77%</b>	<b>3.59%</b>	<b>4.31%</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	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 <sup>a</sup>	257	66	1176	1252	59	176	4491	6041	73	112	3271	4531
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	598	456	0	0	3133	1202	0	0	2687	716
Otros <sup>c</sup>	66	257	246	278	176	59	944	1259	112	73	442	625
<b>Total</b>	<b>323</b>	<b>323</b>	<b>2020</b>	<b>1986</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>8568</b>	<b>8502</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>6400</b>	<b>5872</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.