

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 25 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\$671 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.31%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	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
Total	489,9	513,0	130,6	118,9	50,3	38,9	332,2

^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	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%
Total	4.39%	4.77%	3.59%	4.31%

^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	257	66	1176	1252	59	176	4491	6041	73	112	3271	4531
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	598	456	0	0	3133	1202	0	0	2687	716
Otros ^c	66	257	246	278	176	59	944	1259	112	73	442	625
Total	323	323	2020	1986	235	235	8568	8502	185	185	6400	5872

^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.