

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 26 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\$3455 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.11%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	229,7	166,0	92,3	175,0	57,7	38,7	16,0
15-35	925,4	1412,8	1002,9	491,7	38,9	62,7	371,0
36-60	84,0	7,3	0,0	4,9	7,3	79,1	0,0
61-90	478,4	400,6	311,2	360,0	12,3	41,3	77,1
91-180	33,9	48,2	30,0	0,2	18,2	33,7	0,0
>180	82,4	110,8	45,0	0,0	5,3	21,9	60,5
Total	1834,0	2145,8	1481,4	1031,9	139,8	277,5	524,6

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.02%	3.95%	2.69%	3.25%
15-35	4.93%	4.13%	4.96%	4.50%
36-60	—	4.77%	4.45%	4.47%
61-90	4.00%	4.45%	3.39%	3.51%
91-180	—	3.96%	3.53%	3.78%
>180	4.56%	4.69%	4.00%	4.50%
Total	4.75%	4.13%	3.74%	4.11%

^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.

¹A 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.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	60	1176	1249	55	180	4665	6110	76	114	3283	4630
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	605	456	0	0	3140	1337	0	0	2765	716
Otros ^c	60	257	236	278	180	55	996	1285	114	76	461	634
Total	317	317	2017	1983	235	235	8801	8732	190	190	6509	5980

^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.