

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 29 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\$4269 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.38%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	573,9	246,4	171,6	418,5	12,7	93,2	62,2
15-35	1228,5	1089,4	904,5	1102,4	91,8	33,1	93,0
36-60	155,0	563,9	488,0	49,8	25,9	55,3	50,0
61-90	217,0	89,8	68,3	147,6	11,5	59,4	10,0
91-180	102,4	159,5	121,5	70,0	28,0	22,4	10,0
>180	36,8	31,9	26,7	11,0	4,7	25,3	0,5
Total	2313,7	2180,9	1780,6	1799,3	174,7	288,7	225,6

^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	4.96%		3.48%	4.16%	4.15%
15-35	4.90%		4.91%	4.47%	4.81%
36-60	4.10%		4.38%	4.55%	4.34%
61-90	3.90%		4.14%	3.93%	3.95%
91-180	3.86%		3.80%	3.79%	3.80%
>180	3.97%		4.08%	4.08%	4.08%
Total	4.64%		4.49%	4.20%	4.38%

^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	29 nov. - 03 dic.				06 - 10 dic.				13 - 17 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	63	148	5041	6287	79	113	3349	4718	60	150	6500	10413
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3293	1653	0	0	2818	732	0	0	7139	2282
Otros ^c	148	63	1015	1340	113	79	462	650	150	60	1313	2216
Total	211	211	9349	9280	192	192	6629	6100	210	210	14952	14911

^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.