

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 30 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\$2752 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	581,7	321,6	240,0	509,0	13,1	4,2	68,5
15-35	638,6	685,7	514,1	438,4	23,0	51,7	148,5
36-60	119,7	79,8	0,0	0,0	69,8	109,7	10,0
61-90	213,2	196,2	127,0	138,0	29,2	35,2	40,0
91-180	37,1	51,2	30,0	30,0	21,2	7,1	0,0
>180	92,3	78,9	0,0	0,0	2,4	15,8	76,5
Total	1682,5	1413,5	911,1	1115,4	158,8	223,5	343,5

^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	4.88%		4.70%	3.97%	4.28%
15-35	4.84%		4.60%	—	4.64%
36-60	4.49%		4.28%	4.54%	4.45%
61-90	3.97%		4.08%	3.83%	3.92%
91-180	—		3.83%	3.76%	3.80%
>180	4.18%		4.23%	3.79%	4.11%
Total	4.59%		4.51%	4.21%	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	44	105	4652	5502	80	113	3403	4785	60	151	6581	10524
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3189	1880	0	0	2828	732	0	0	7239	2349
Otros ^c	105	44	512	908	113	80	465	651	151	60	1323	2227
Total	149	149	8353	8290	193	193	6696	6168	211	211	15143	15100

^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.