

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de diciembre de 2021**  
**Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$3570 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	795,4	283,6	208,8	702,2	14,5	32,9	60,2
15-35	543,7	1158,8	876,2	288,6	35,6	8,2	247,0
36-60	165,1	71,2	0,5	0,0	27,3	121,6	43,5
61-90	215,9	190,5	134,0	130,0	38,5	67,9	18,0
91-180	43,9	75,3	57,0	42,8	18,3	1,1	0,0
>180	215,9	204,8	95,0	183,4	84,4	7,1	25,4
<b>Total</b>	<b>1979,9</b>	<b>1984,2</b>	<b>1371,5</b>	<b>1347,0</b>	<b>218,6</b>	<b>238,8</b>	<b>394,1</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.43%	4.40%	3.57%	3.81%
15-35	4.26%	4.01%	4.37%	4.12%
36-60	4.45%	4.18%	3.66%	3.91%
61-90	3.51%	12.19%	3.62%	7.72%
91-180	—	3.67%	3.71%	3.68%
>180	3.85%	3.92%	3.34%	3.65%
<b>Total</b>	<b>4.25%</b>	<b>4.96%</b>	<b>3.68%</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$ . 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 <sup>a</sup>	40	63	3968	4335	80	124	3541	4912	60	154	6792	10741
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2617	1882	0	0	2924	830	0	0	7363	2445
Otros <sup>c</sup>	63	40	280	624	124	80	463	656	154	60	1329	2255
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>6865</b>	<b>6841</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>6928</b>	<b>6398</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>15484</b>	<b>15441</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.