

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 02 de diciembre 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\$5861 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.71%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	1440,6	431,9	140,7	1116,2	20,2	53,5	271,0
15-35	667,2	1265,7	1108,1	521,9	31,8	19,4	125,8
36-60	313,5	77,9	9,6	201,3	68,3	112,2	0,0
61-90	410,9	600,8	581,3	404,0	19,5	6,9	0,0
91-180	327,4	587,6	348,0	91,5	24,6	20,9	215,0
>180	57,3	341,7	290,0	5,0	1,7	2,3	50,0
Total	3216,9	3305,7	2477,8	2339,9	166,1	215,2	661,8

^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	4.00%	3.56%	3.45%	3.56%
15-35	3.95%	3.96%	3.90%	3.95%
36-60	—	3.99%	3.60%	3.75%
61-90	—	3.61%	3.54%	3.59%
91-180	3.46%	3.55%	3.37%	3.49%
>180	4.14%	4.04%	3.70%	4.12%
Total	3.82%	3.85%	3.53%	3.71%

^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	27	54	3413	3511	83	123	4414	5268	60	155	7266	10804
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1962	1475	0	0	2994	1443	0	0	7397	2866
Otros ^c	54	27	191	558	123	83	473	637	155	60	1334	2277
Total	81	81	5566	5544	206	206	7881	7348	215	215	15997	15947

^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.