INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 04 de noviembre de 2021[1]

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$2151 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.32%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	416,6	432,3	255,4	191,2	67,9	116,4	109
15-35	617,9	826,1	361,2	130,7	56,0	78,2	409
36-60	41,3	9,6	1,0	33,0	8,6	8,3	0
61-90	111,0	52,6	0,0	0,0	2,6	61,0	50
91-180	89,3	106,7	20,0	25,2	37,7	15,1	49
>180	60,1	4,4	0,8	52,0	3,5	8,1	0
Total	**1336,1**	**1431,7**	**638,4**	**432,1**	**176,3**	**287,0**	**617**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	3.25%	3.06%	3.21%	3.16%
15-35	3.43%	3.53%	3.24%	3.43%
36-60	–	3.31%	3.22%	3.23%
61-90	3.24%	3.04%	3.00%	3.11%
91-180	3.28%	3.25%	3.11%	3.23%
>180	–	3.96%	3.68%	3.70%
Total	**3.37%**	**3.34%**	**3.25%**	**3.32%**

[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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	01 – 05 nov.				08 - 12 nov.				15 - 19 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	68	62	2654	2812	72	156	3818	4431	32	154	4234	4366
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1837	1473	0	0	2394	1337	0	0	1887	1269
Otros[c]	62	68	235	397	156	72	735	1066	154	32	903	1300
Total	**130**	**130**	**4726**	**4682**	**228**	**228**	**6947**	**6834**	**186**	**186**	**7024**	**6935**

[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.