INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 08 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$2017 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.28%[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	356,2	515,5	184,2	184,7	203,9	44,0	127,5
15-35	407,9	552,5	382,4	221,2	13,5	30,1	156,5
36-60	11,9	63,2	50,9	0,2	9,8	9,2	2,5
61-90	45,2	4,5	0,0	0,0	4,5	45,2	0,0
91-180	280,5	57,5	25,0	75,0	17,5	190,5	15,0
>180	15,9	22,3	5,0	0,0	2,3	0,9	15,0
Total	**1117,5**	**1215,6**	**647,5**	**481,1**	**251,5**	**319,9**	**316,5**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	3.34%	3.33%	2.88%	3.25%
15-35	3.35%	3.44%	3.29%	3.37%
36-60	3.10%	3.56%	3.03%	3.28%
61-90	–	3.28%	3.03%	3.05%
91-180	3.05%	3.40%	3.04%	3.07%
>180	4.26%	4.17%	3.39%	4.20%
Total	**3.37%**	**3.40%**	**3.09%**	**3.28%**

[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

	08 – 12 nov.				15 - 19 nov.				22 - 26 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	74	158	4184	4817	37	154	4423	4719	62	160	3775	5319
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2687	1589	0	0	1898	1276	0	0	2974	920
Otros[c]	158	74	772	1118	154	37	1114	1351	160	62	900	1346
Total	**232**	**232**	**7643**	**7524**	**191**	**191**	**7435**	**7346**	**222**	**222**	**7649**	**7585**

[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.