INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 12 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$3262 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.93%[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	601,4	355,8	90,0	346,0	116,5	106,1	149,3
15-35	686,5	1474,5	1073,6	257,8	145,9	173,7	255,0
36-60	9,8	6,5	0,0	0,0	6,5	9,8	0,0
61-90	9,7	36,0	3,8	0,0	30,6	8,0	1,6
91-180	141,3	95,0	0,0	130,0	95,0	11,3	0,0
>180	156,1	215,3	85,0	30,0	9,8	5,6	120,5
Total	**1604,8**	**2183,1**	**1252,3**	**763,8**	**404,3**	**314,5**	**526,5**

[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	3.21%	2.75%	2.15%	2.49%
15-35	3.22%	3.00%	2.82%	3.01%
36-60	–	1.93%	2.49%	2.27%
61-90	2.74%	3.07%	3.06%	3.05%
91-180	–	3.17%	2.99%	3.07%
>180	3.89%	3.69%	3.74%	3.81%
Total	**3.37%**	**3.02%**	**2.52%**	**2.93%**

[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]	22	72	577	568	50	153	6112	5874	68	162	4349	5934
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	267	328	0	0	2263	2083	0	0	3143	1150
Otros[c]	72	22	211	156	153	50	1238	1568	162	68	1071	1411
Total	**94**	**94**	**1055**	**1052**	**203**	**203**	**9613**	**9525**	**230**	**230**	**8563**	**8495**

[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.