INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 18 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$3757 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.21%[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	340,3	309,1	97,5	234,4	161,6	55,9	50,0
15-35	753,3	842,9	502,5	340,5	45,0	117,2	295,5
36-60	16,9	510,6	500,0	6,0	10,6	10,9	0,0
61-90	524,3	103,4	84,9	502,8	18,5	21,5	0,0
91-180	170,6	282,6	80,0	5,0	72,6	35,6	130,0
>180	225,0	215,4	111,0	1,2	42,4	161,7	62,0
Total	**2030,4**	**2264,1**	**1375,9**	**1089,9**	**350,7**	**402,9**	**537,5**

[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	4.99%	2.54%	3.55%	3.14%
15-35	4.92%	4.98%	4.85%	4.91%
36-60	–	4.19%	4.09%	4.13%
61-90	–	3.92%	3.75%	3.88%
91-180	3.84%	3.79%	3.31%	3.75%
>180	4.30%	4.20%	4.01%	4.13%
Total	**4.59%**	**3.92%**	**4.31%**	**4.21%**

[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

	15 – 19 nov.				22 - 26 nov.				29 nov. - 03 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	18	93	3649	3371	316	228	4680	6366	30	166	3965	5050
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1645	1817	0	0	3217	1313	0	0	2693	948
Otros[c]	93	18	554	613	228	316	1306	1457	166	30	613	1207
Total	**111**	**111**	**5848**	**5801**	**544**	**544**	**9203**	**9136**	**196**	**196**	**7271**	**7205**

[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.