INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 03 de diciembre 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$2640 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.86%[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	984,4	311,3	105,1	746,5	7,5	39,2	198,8
15-35	281,0	696,5	532,3	129,3	27,2	14,7	137,0
36-60	64,5	51,2	10,0	45,0	37,5	15,7	3,8
61-90	32,9	220,4	186,0	0,0	4,4	2,9	30,0
91-180	132,9	236,0	170,0	76,1	16,0	6,8	50,0
>180	24,5	43,8	20,0	0,0	3,8	4,5	20,0
Total	**1520,2**	**1559,3**	**1023,4**	**996,9**	**96,4**	**83,8**	**439,5**

[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	4.01%	3.69%	3.95%	3.97%
15-35	3.94%	3.94%	3.73%	3.90%
36-60	3.79%	3.78%	3.63%	3.72%
61-90	3.47%	3.63%	3.34%	3.57%
91-180	3.44%	3.74%	3.44%	3.49%
>180	3.92%	4.08%	3.42%	3.95%
Total	**3.88%**	**3.86%**	**3.83%**	**3.86%**

[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

	29 nov. - 03 dic.				06 - 10 dic.				13 - 17 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	10	26	1057	1058	87	127	5111	5434	64	156	7425	10861
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	631	680	0	0	3055	2013	0	0	7448	3016
Otros[c]	26	10	117	61	127	87	474	659	156	64	1339	2287
Total	**36**	**36**	**1805**	**1799**	**214**	**214**	**8640**	**8106**	**220**	**220**	**16212**	**16164**

[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.