

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 06 de diciembre de 2021¹

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\$3994 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.61%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1278,6	484,6	100,7	1139,3	303,3	58,7	80,6
15-35	448,8	1032,3	803,5	244,7	37,8	13,2	191,0
36-60	153,8	230,5	151,2	0,0	44,8	119,3	34,5
61-90	42,2	50,3	10,0	2,1	5,3	5,1	35,0
91-180	66,2	496,0	425,0	24,0	66,0	37,2	5,0
>180	4,7	54,7	51,0	0,0	1,7	2,7	2,0
Total	1994,3	2348,3	1541,4	1410,1	458,8	236,1	348,1

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	3.12%		3.86%	2.98%	3.28%
15-35	3.98%		3.95%	4.02%	3.97%
36-60	3.89%		3.92%	3.70%	3.78%
61-90	3.68%		3.87%	3.49%	3.68%
91-180	3.64%		3.63%	3.58%	3.62%
>180	3.90%		4.06%	3.71%	3.89%
Total	3.74%		3.88%	3.25%	3.61%

^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.

¹A 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.

²El 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

Sectores	06 – 10 dic.				13 - 17 dic.				20 - 24 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	97	131	5643	5598	69	157	7973	11166	16	112	2495	3583
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3169	2481	0	0	7454	3512	0	0	2263	1195
Otros ^c	131	97	492	659	157	69	1626	2327	112	16	312	256
Total	228	228	9304	8738	226	226	17053	17005	128	128	5070	5034

^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.