

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 07 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\$3373 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.74%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1135,4	502,2	181,0	872,3	150,1	92,1	171
15-35	367,0	1034,3	762,1	161,7	74,2	7,3	198
36-60	110,6	95,9	8,1	3,0	42,8	62,6	45
61-90	23,9	81,6	38,5	0,0	27,1	7,9	16
91-180	45,1	305,7	190,0	29,4	100,7	0,7	15
>180	110,3	16,4	0,0	50,0	6,4	50,3	10
Total	1792,3	2036,0	1179,7	1116,3	401,3	221,0	455

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.22%	3.55%	3.19%	3.44%
15-35	4.09%	4.09%	4.07%	4.09%
36-60	4.05%	4.02%	3.81%	3.94%
61-90	3.76%	3.52%	3.46%	3.56%
91-180	3.70%	3.75%	3.78%	3.75%
>180	4.08%	4.12%	3.83%	3.87%
Total	4.11%	3.86%	3.42%	3.74%

^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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ { (365 / \text{Plazo})}) - 1$. 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	73	108	4058	3414	68	161	8446	11352	19	116	2511	3589
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1879	1637	0	0	7501	3847	0	0	2263	1210
Otros ^c	108	73	343	677	161	68	1765	2419	116	19	319	257
Total	181	181	6280	5728	229	229	17712	17618	135	135	5093	5056

^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.