

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 09 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\$2762 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.87%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	640,8	469,3	96,4	572,8	321,4	16,5	51,5
15-35	186,2	721,1	633,5	87,2	12,6	24,1	75,0
36-60	146,6	51,5	30,6	3,0	19,9	142,6	1,0
61-90	18,7	46,2	0,0	0,0	36,2	8,7	10,0
91-180	288,7	320,8	250,1	17,4	50,6	251,3	20,0
>180	21,0	28,7	0,0	0,0	8,7	1,0	20,0
Total	1302,0	1637,5	1010,6	680,4	449,4	444,1	177,5

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.22%	3.34%	3.51%	3.48%
15-35	4.25%	4.43%	4.36%	4.39%
36-60	4.15%	4.22%	4.12%	4.13%
61-90	4.04%	4.10%	3.96%	4.07%
91-180	3.93%	3.94%	3.73%	3.83%
>180	4.00%	4.30%	4.31%	4.09%
Total	4.16%	3.95%	3.73%	3.87%

^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	63	74	3181	2501	66	167	8912	11810	21	116	2509	3580
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1249	1113	0	0	7583	4142	0	0	2267	1210
Otros ^c	74	63	218	507	167	66	2100	2549	116	21	306	255
Total	137	137	4648	4121	233	233	18595	18501	137	137	5082	5045

^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.