

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 10 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\$3395 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.29%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	532,2	575,8	245,2	390,2	294,6	106,0	36,0
15-35	676,4	948,2	737,7	491,8	46,0	20,2	164,5
36-60	248,4	100,7	26,1	25,0	49,6	198,4	25,0
61-90	198,0	164,5	40,0	91,1	89,5	71,9	35,0
91-180	25,2	35,2	0,0	0,0	35,2	25,2	0,0
>180	72,2	124,0	70,0	20,0	8,5	6,7	45,5
Total	1752,5	1948,4	1119,0	1018,0	523,4	428,5	306,0

^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	3.32%		4.25%	4.17%	4.17%
15-35	4.57%		4.37%	4.58%	4.45%
36-60	4.41%		4.51%	4.07%	4.21%
61-90	4.27%		4.28%	4.22%	4.25%
91-180	—		4.22%	4.04%	4.14%
>180	4.49%		4.17%	4.36%	4.34%
Total	4.36%		4.32%	4.24%	4.29%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{365/\text{Plazo}}}) - 1$. 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	15	30	898	874	190	166	9505	12380	25	118	2513	3587
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	624	402	0	0	7825	4560	0	0	2267	1211
Otros ^c	30	15	38	268	166	190	2373	2668	118	25	313	257
Total	45	45	1560	1544	356	356	19703	19608	143	143	5093	5055

^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.