

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2021**  
**Fecha de Información: 10 de diciembre de 2021<sup>1</sup>**

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%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		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
<b>Total</b>	<b>1752,5</b>	<b>1948,4</b>	<b>1119,0</b>	<b>1018,0</b>	<b>523,4</b>	<b>428,5</b>	<b>306,0</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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%
<b>Total</b>	<b>4.36%</b>	<b>4.32%</b>	<b>4.24%</b>	<b>4.29%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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 <sup>a</sup>	15	30	898	874	190	166	9505	12380	25	118	2513	3587
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	624	402	0	0	7825	4560	0	0	2267	1211
Otros <sup>c</sup>	30	15	38	268	166	190	2373	2668	118	25	313	257
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>1560</b>	<b>1544</b>	<b>356</b>	<b>356</b>	<b>19703</b>	<b>19608</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5093</b>	<b>5055</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.