

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2021**  
**Fecha de Información: 14 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\$3779 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.66%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	961,5	421,2	233,8	669,4	1,8	106,6	185,5
15-35	685,1	1263,2	970,4	402,8	33,1	22,6	259,7
36-60	52,0	333,6	271,1	1,0	57,5	46,0	5,0
61-90	259,2	167,5	45,0	137,0	22,5	22,3	100,0
91-180	28,6	19,0	11,9	15,0	7,1	13,5	0,0
>180	35,7	107,7	95,0	20,0	7,7	10,7	5,0
<b>Total</b>	<b>2022,1</b>	<b>2312,2</b>	<b>1627,2</b>	<b>1245,3</b>	<b>129,8</b>	<b>221,7</b>	<b>555,2</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	4.76%	4.89%	4.23%	4.42%
15-35	4.88%	4.90%	4.72%	4.88%
36-60	3.88%	5.03%	4.60%	4.79%
61-90	4.39%	4.49%	4.33%	4.38%
91-180	—	4.93%	4.24%	4.48%
>180	4.78%	4.69%	4.28%	4.52%
<b>Total</b>	<b>4.74%</b>	<b>4.89%</b>	<b>4.32%</b>	<b>4.66%</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	13 – 17 dic.				20 - 24 dic.				27 - 31 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	172	183	6061	7162	29	120	2662	3837	37	112	3859	5514
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4411	3031	0	0	2416	1253	0	10	4371	2692
Otros <sup>c</sup>	183	172	1086	1310	120	29	316	267	112	27	300	277
<b>Total</b>	<b>355</b>	<b>355</b>	<b>11558</b>	<b>11503</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>5394</b>	<b>5357</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>8530</b>	<b>8483</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.