

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 15 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\$2559 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.80%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	373,4	154,8	73,3	289,4	15,5	18,0	66,0
15-35	554,5	920,4	622,1	273,5	56,1	38,8	242,2
36-60	118,9	108,5	50,0	0,1	43,5	103,9	15,0
61-90	146,0	254,2	219,1	101,7	5,1	14,3	30,0
91-180	52,2	10,7	2,0	41,3	8,7	10,9	0,0
>180	104,0	164,3	113,0	44,7	1,3	9,3	50,0
Total	1348,9	1612,9	1079,5	750,6	130,1	195,1	403,3

^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	5.12%	4.97%	4.06%	4.55%
15-35	4.97%	5.03%	5.05%	5.01%
36-60	4.67%	4.72%	4.76%	4.74%
61-90	4.62%	4.15%	3.53%	4.10%
91-180	—	4.82%	4.22%	4.44%
>180	5.06%	4.94%	4.70%	4.96%
Total	4.97%	4.84%	4.58%	4.80%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ { (365/\text{Plazo})})$
- 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 ^a	167	164	4534	5557	32	119	2671	3867	38	113	3977	5598
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3442	2268	0	0	2444	1255	0	10	4371	2721
Otros ^c	164	167	808	921	119	32	316	272	113	28	299	281
Total	331	331	8784	8746	151	151	5431	5394	151	151	8647	8600

^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.