

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2021**  
**Fecha de Información: 16 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\$1971 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.74%<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	223,2	159,3	138,6	197,2	11,8	17,0	9,0
15-35	505,0	892,3	636,9	190,9	6,0	64,5	249,5
36-60	36,4	4,4	0,0	0,0	4,4	36,4	0,0
61-90	37,5	68,1	16,0	0,0	27,1	12,5	25,0
91-180	84,0	166,9	99,1	12,4	12,8	16,6	55,0
>180	94,2	43,6	35,0	48,2	3,6	41,0	5,0
<b>Total</b>	<b>980,2</b>	<b>1334,6</b>	<b>925,5</b>	<b>448,8</b>	<b>65,6</b>	<b>188,0</b>	<b>343,5</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.07%		4.89%	4.47%	4.58%
15-35	4.99%		4.68%	5.03%	4.83%
36-60	—		4.98%	4.77%	4.80%
61-90	4.60%		4.68%	4.35%	4.59%
91-180	4.61%		4.58%	4.54%	4.58%
>180	5.01%		4.84%	4.69%	4.76%
<b>Total</b>	<b>4.91%</b>		<b>4.69%</b>	<b>4.71%</b>	<b>4.74%</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>	28	92	3272	3986	33	119	2685	3895	38	112	3992	5674
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2624	1711	0	0	2468	1262	0	10	4433	2726
Otros <sup>c</sup>	92	28	400	578	119	33	320	279	112	28	304	281
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>6296</b>	<b>6275</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>5473</b>	<b>5436</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>8729</b>	<b>8681</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.