

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 16 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\$1971 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.74%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	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
Total	980,2	1334,6	925,5	448,8	65,6	188,0	343,5

^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	5.07%	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%
Total	4.91%	4.69%	4.71%	4.74%

^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.

¹ 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.

² 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 ^a	28	92	3272	3986	33	119	2685	3895	38	112	3992	5674
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2624	1711	0	0	2468	1262	0	10	4433	2726
Otros ^c	92	28	400	578	119	33	320	279	112	28	304	281
Total	120	120	6296	6275	152	152	5473	5436	150	150	8729	8681

^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.