

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 20 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\$1485 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.48%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	334,8	185,5	85,1	227,0	5,1	12,5	95,3
15-35	468,1	482,4	269,8	271,6	33,7	17,5	179,0
36-60	19,1	65,5	50,0	0,0	15,5	19,1	0,0
61-90	23,9	152,2	115,6	0,0	26,5	13,9	10,0
91-180	6,4	27,0	10,0	0,0	17,0	6,4	0,0
>180	0,7	4,1	0,2	0,0	3,9	0,7	0,0
Total	852,9	916,7	530,8	498,6	101,7	70,1	284,3

^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	3.57%	4.76%	4.19%	4.05%
15-35	4.61%	4.72%	4.75%	4.69%
36-60	—	4.84%	4.38%	4.59%
61-90	4.45%	4.55%	4.35%	4.51%
91-180	—	4.70%	4.38%	4.64%
>180	—	5.07%	4.32%	4.96%
Total	4.26%	4.70%	4.43%	4.48%

^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	20 – 24 dic.				27 - 31 dic.				03 - 07 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	133	3292	4016	40	111	4116	5776	22	88	2958	4693
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2559	1836	0	10	4452	2769	0	0	3504	1723
Otros ^c	133	44	328	290	111	30	310	286	88	22	212	180
Total	177	177	6179	6142	151	151	8878	8831	110	110	6674	6596

^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.