

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 21 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\$1888 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.19%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	509,8	187,0	176,2	442,1	1,8	58,7	9,0
15-35	375,0	613,7	509,9	285,8	23,3	8,7	80,5
36-60	45,7	72,1	0,0	8,4	62,1	27,3	10,0
61-90	13,8	61,1	22,0	0,7	29,2	3,1	10,0
91-180	1,5	40,8	25,0	0,0	15,8	1,5	0,0
>180	73,6	30,8	0,0	40,0	2,8	5,6	28,0
Total	1019,5	1005,6	733,1	777,0	135,0	105,0	137,5

^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	4.61%	4.79%	3.64%	3.82%
15-35	4.63%	4.27%	4.55%	4.38%
36-60	4.26%	4.51%	4.40%	4.46%
61-90	4.30%	4.38%	4.13%	4.35%
91-180	—	4.35%	4.07%	4.33%
>180	4.89%	4.99%	4.78%	4.86%
Total	4.63%	4.37%	3.91%	4.19%

^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	33	120	2332	2735	37	112	4233	5877	22	88	3088	4888
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1764	1335	0	10	4536	2840	0	0	3677	1827
Otros ^c	120	33	262	260	112	27	313	316	88	22	213	182
Total	153	153	4358	4330	149	149	9082	9033	110	110	6978	6897

^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.