

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 22 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\$1517 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.36%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	310,4	81,9	59,1	280,5	4,8	11,9	18
15-35	361,5	604,8	463,0	225,5	20,8	15,0	121
36-60	109,5	68,2	22,5	0,0	5,7	69,5	40
61-90	20,0	47,5	23,7	0,8	13,8	9,3	10
91-180	1,5	16,5	0,0	0,0	16,5	1,5	0
>180	61,4	63,0	7,6	20,0	15,4	1,4	40
Total	864,3	881,8	575,8	526,8	77,0	108,5	229

^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	4.42%	4.81%	3.85%	3.92%
15-35	4.49%	4.46%	4.45%	4.47%
36-60	4.66%	4.61%	4.26%	4.45%
61-90	4.12%	4.40%	3.97%	4.19%
91-180	—	4.44%	4.70%	4.46%
>180	5.04%	4.76%	4.74%	4.89%
Total	4.60%	4.50%	4.07%	4.36%

^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	24	100	2012	2225	38	108	4441	5881	23	87	3205	5025
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1464	1220	0	10	4536	3043	0	0	3804	1931
Otros ^c	100	24	193	202	108	28	317	323	87	23	214	185
Total	124	124	3669	3647	146	146	9294	9247	110	110	7223	7141

^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.