

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 23 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\$1686 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.98%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	380,3	70,2	18,4	325,3	5,8	9,0	46,0
15-35	411,3	782,5	462,6	54,5	15,4	52,3	304,5
36-60	103,8	113,6	0,0	0,0	11,6	1,8	102,0
61-90	165,8	143,4	25,0	25,0	6,4	28,8	112,0
91-180	56,1	16,8	0,0	45,0	6,8	1,1	10,0
>180	7,2	10,0	0,0	0,0	10,0	7,2	0,0
Total	1124,5	1136,5	506,0	449,8	56,0	100,2	574,5

^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	4.18%	4.47%	3.33%	3.50%
15-35	4.24%	4.06%	4.24%	4.15%
36-60	4.06%	4.00%	4.12%	4.06%
61-90	4.08%	3.93%	4.08%	4.06%
91-180	4.15%	4.17%	4.13%	4.14%
>180	—	4.61%	4.80%	4.69%
Total	4.17%	4.09%	3.64%	3.98%

^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	7	53	940	1179	32	120	4680	5914	25	85	3268	5073
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	800	565	0	10	4554	3275	0	0	3804	1948
Otros ^c	53	7	54	41	120	22	332	330	85	25	217	187
Total	60	60	1794	1785	152	152	9566	9519	110	110	7289	7208

^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.