

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 27 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\$1585 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.01%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	395,5	260,7	138,7	274,0	11,5	11,0	110,5
15-35	570,5	707,6	327,6	192,7	24,5	22,3	355,5
36-60	14,6	19,3	5,0	0,0	4,3	4,6	10,0
61-90	32,8	14,1	4,8	21,7	9,3	11,1	0,0
91-180	15,7	28,7	0,0	15,0	28,7	0,7	0,0
>180	0,4	1,0	0,0	0,0	1,0	0,4	0,0
Total	1029,4	1031,4	476,1	503,4	79,4	50,0	476,0

^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	4.26%	2.33%	4.19%	3.91%
15-35	4.10%	3.92%	4.07%	4.04%
36-60	4.12%	4.37%	3.87%	4.17%
61-90	—	4.19%	3.94%	4.05%
91-180	—	4.11%	4.50%	4.25%
>180	—	4.98%	4.51%	4.86%
Total	4.14%	3.69%	4.16%	4.01%

^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	27 – 31 dic.				03 - 07 ene.				10 - 14 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	145	5149	6214	27	82	3425	5223	50	110	4953	6818
Intragrupo y off-shore ^b	0	10	4718	3608	0	0	3893	2021	0	0	4710	2041
Otros ^c	145	21	343	330	82	27	230	223	110	50	637	1279
Total	176	176	10210	10152	109	109	7548	7467	160	160	10300	10138

^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.