

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 28 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\$1749 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.10%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	375,0	283,5	124,7	214,4	5,5	7,4	153,2
15-35	438,8	815,2	493,0	122,9	51,7	45,4	270,5
36-60	54,4	31,6	0,0	4,6	11,6	29,8	20,0
61-90	13,2	32,6	13,4	1,0	19,2	12,3	0,0
91-180	103,7	54,0	15,0	65,0	14,0	13,7	25,0
>180	13,9	13,7	0,0	0,0	1,7	1,9	12,0
Total	998,9	1230,7	646,2	407,9	103,8	110,4	480,7

^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	3.98%	3.92%	3.88%	3.93%
15-35	4.24%	4.09%	4.13%	4.15%
36-60	4.23%	4.12%	4.06%	4.13%
61-90	—	4.03%	3.87%	3.97%
91-180	4.39%	4.16%	4.14%	4.19%
>180	5.08%	5.12%	4.64%	5.03%
Total	4.19%	4.09%	4.03%	4.10%

^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	30	133	4695	5618	27	83	3451	5244	51	113	5003	6854
Intragrupo y off-shore ^b	0	10	4249	3367	0	0	3893	2021	0	0	4729	2067
Otros ^c	133	20	304	221	83	27	232	224	113	51	639	1278
Total	163	163	9248	9206	110	110	7576	7489	164	164	10371	10199

^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.