

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de enero de 2022**

**Fecha de Información: 29 de diciembre de 2021<sup>1</sup>**

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\$1350 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.15%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	185,2	86,5	17,5	117,0	12,0	11,2	57
15-35	466,7	500,9	310,5	194,2	7,4	89,5	183
36-60	38,9	13,2	0,0	2,8	13,2	36,1	0
61-90	47,9	63,9	11,5	2,2	12,4	5,7	40
91-180	12,8	13,7	0,0	1,4	13,7	11,4	0
>180	84,9	184,8	80,0	10,5	34,8	4,5	70
<b>Total</b>	<b>836,6</b>	<b>863,1</b>	<b>419,5</b>	<b>328,1</b>	<b>93,6</b>	<b>158,5</b>	<b>350</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.01%	4.06%	3.00%	3.45%
15-35	4.14%	4.12%	4.11%	4.12%
36-60	—	4.12%	3.99%	4.02%
61-90	4.06%	4.11%	3.78%	4.05%
91-180	—	4.38%	3.92%	4.17%
>180	4.78%	4.93%	4.50%	4.84%
<b>Total</b>	<b>4.23%</b>	<b>4.38%</b>	<b>3.83%</b>	<b>4.15%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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 <sup>a</sup>	23	68	3358	3864	26	81	3450	5253	64	113	5007	6861
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	10	2923	2408	0	0	3892	2022	0	0	4733	2068
Otros <sup>c</sup>	68	13	185	162	81	26	242	223	113	64	642	1280
<b>Total</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>6466</b>	<b>6434</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>7584</b>	<b>7498</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>10382</b>	<b>10209</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.