

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de enero de 2022

Fecha de Información: 03 de enero de 2022¹

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\$2456 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.94%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	868,4	412,6	94,1	540,2	9,9	19,6	308,6
15-35	501,1	1127,9	726,5	130,1	56,2	25,8	345,3
36-60	9,6	9,2	0,0	0,0	4,2	4,6	5,0
61-90	83,2	24,5	0,0	61,9	14,5	11,4	10,0
91-180	8,2	6,4	0,0	0,0	6,4	8,2	0,0
>180	5,7	68,2	60,0	0,0	8,2	5,7	0,0
Total	1476,2	1648,8	880,6	732,1	99,3	75,3	668,8

^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	4.10%	4.22%	3.28%	3.61%
15-35	4.11%	4.20%	4.04%	4.17%
36-60	4.20%	4.69%	3.72%	4.19%
61-90	4.22%	4.29%	3.94%	4.16%
91-180	—	4.52%	3.87%	4.15%
>180	—	4.93%	4.04%	4.56%
Total	4.11%	4.22%	3.38%	3.94%

^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.

¹A 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.

²El 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	03 – 07 ene.				10 - 14 ene.				17 - 21 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	29	93	4111	5513	94	115	5368	7154	25	112	4407	4885
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4093	2638	0	0	4746	2156	0	0	2806	1557
Otros ^c	93	29	260	227	115	94	654	1286	112	25	1018	1736
Total	122	122	8464	8378	209	209	10768	10596	137	137	8231	8178

^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.