

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de enero de 2022
Fecha de Información: 04 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\$2073 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.91%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	414,5	223,6	189,4	373,2	6,2	13,3	28
15-35	509,1	941,8	696,0	222,2	21,9	62,9	224
36-60	76,6	71,8	0,0	3,0	6,8	8,6	65
61-90	34,2	12,3	0,0	0,0	5,3	27,2	7
91-180	39,7	16,0	0,9	25,0	5,1	4,7	10
>180	5,5	61,3	47,4	3,1	13,9	2,5	0
Total	1079,7	1326,8	933,7	626,5	59,1	119,3	334

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.31%		3.87%	2.74%	2.91%
15-35	4.32%		4.14%	4.23%	4.20%
36-60	4.40%		4.58%	3.95%	4.36%
61-90	4.31%		4.43%	4.16%	4.22%
91-180	4.62%		4.62%	4.13%	4.51%
>180	—		4.86%	4.59%	4.82%
Total	4.35%		4.19%	3.21%	3.91%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	17	90	4095	5254	98	112	5391	7179	28	115	4432	4945
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3958	2740	0	0	4757	2163	0	0	2845	1558
Otros ^c	90	17	233	207	112	98	656	1289	115	28	1023	1744
Total	107	107	8286	8201	210	210	10804	10631	143	143	8300	8247

^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.