

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de enero de 2022
Fecha de Información: 05 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\$3356 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.81%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	626,9	321,5	80,9	528,1	155,7	13,9	85
15-35	529,1	1372,7	1092,5	273,3	45,2	20,8	235
36-60	33,5	72,5	34,4	0,0	8,1	3,5	30
61-90	140,1	127,4	10,0	41,5	22,4	3,6	95
91-180	5,0	9,8	0,0	0,0	9,8	5,0	0
>180	468,4	153,9	85,0	275,0	8,9	133,4	60
Total	1803,0	2057,9	1302,7	1117,9	250,1	180,1	505

^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	4.55%		1.20%	3.34%	2.95%
15-35	4.50%		3.63%	4.36%	3.85%
36-60	4.46%		4.42%	4.06%	4.42%
61-90	4.39%		4.50%	3.69%	4.21%
91-180	—		4.71%	4.39%	4.60%
>180	4.76%		5.01%	4.36%	4.49%
Total	4.52%		3.44%	3.94%	3.81%

^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	10	77	3276	3925	97	111	5525	7376	31	118	4528	5073
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2853	2153	0	0	4763	2223	0	0	2932	1618
Otros ^c	77	10	205	174	111	97	797	1298	118	31	1058	1758
Total	87	87	6334	6252	208	208	11085	10897	149	149	8518	8449

^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.