

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de enero de 2022
Fecha de Información: 06 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\$2852 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.22%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	228,5	274,0	77,0	141,0	132,0	22,4	65,1
15-35	912,5	1159,8	792,2	555,5	37,6	26,9	330,0
36-60	62,6	47,3	0,0	0,0	7,3	22,6	40,0
61-90	45,6	51,8	0,0	15,0	21,8	0,6	30,0
91-180	207,3	97,9	0,0	10,0	27,9	127,3	70,0
>180	105,3	294,8	193,0	0,0	1,8	5,3	100,0
Total	1561,7	1925,7	1062,2	721,5	228,4	205,1	635,1

^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	4.62%		3.96%	3.70%	3.96%
15-35	4.56%		3.78%	4.26%	4.08%
36-60	4.52%		4.70%	4.57%	4.55%
61-90	4.54%		4.78%	4.48%	4.60%
91-180	4.50%		4.63%	4.58%	4.56%
>180	4.74%		4.91%	5.05%	4.85%
Total	4.58%		4.04%	4.21%	4.22%

^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	7	51	2124	2582	97	111	5760	7579	31	118	4576	5159
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1796	1257	0	0	4788	2411	0	0	3017	1648
Otros ^c	51	7	137	141	111	97	930	1300	118	31	1060	1776
Total	58	58	4057	3980	208	208	11478	11290	149	149	8653	8583

^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.