

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de enero de 2022
Fecha de Información: 07 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\$1660 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.45%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	483,6	188,9	163,4	425,2	15,5	48,3	10,0
15-35	189,4	606,4	515,0	101,7	41,4	37,6	50,0
36-60	61,3	8,4	1,2	28,0	7,2	33,3	0,0
61-90	25,9	31,4	7,0	6,8	14,4	9,1	10,0
91-180	40,1	57,5	40,0	20,0	4,5	7,1	13,0
>180	6,5	48,9	28,2	0,0	15,2	1,0	5,5
Total	806,8	941,5	754,8	581,7	98,2	136,5	88,5

^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%		4.66%	4.09%	4.25%
15-35	4.79%		4.56%	4.52%	4.57%
36-60	—		4.82%	4.71%	4.73%
61-90	4.76%		4.91%	4.44%	4.74%
91-180	4.66%		4.60%	4.54%	4.59%
>180	5.14%		4.85%	4.73%	4.88%
Total	4.77%		4.61%	4.23%	4.45%

^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	2	25	332	513	103	124	6405	7718	34	121	4592	5262
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	361	137	0	0	4866	2953	0	0	3102	1649
Otros ^c	25	2	61	98	124	103	922	1334	121	34	1067	1781
Total	27	27	754	748	227	227	12193	12005	155	155	8761	8692

^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.