

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2022
Fecha de Información: 11 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\$4698 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.25%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	1284,6	572,7	180,3	1043,4	231,9	80,7	160,5
15-35	490,2	2072,6	1836,1	293,2	79,5	40,0	157,0
36-60	19,1	34,5	5,0	4,0	29,5	15,1	0,0
61-90	200,0	155,2	60,2	8,6	89,9	186,4	5,0
91-180	63,1	14,1	0,0	50,0	14,1	13,1	0,0
>180	11,0	113,5	99,7	0,0	3,8	1,0	10,0
Total	2068,0	2962,6	2181,4	1399,2	448,7	336,2	332,5

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.86%	2.54%	3.78%	3.57%
15-35	4.93%	4.82%	4.82%	4.83%
36-60	—	5.13%	4.76%	5.00%
61-90	4.80%	4.95%	4.57%	4.70%
91-180	—	5.37%	4.51%	4.95%
>180	4.85%	5.12%	4.19%	5.06%
Total	4.89%	4.27%	4.08%	4.25%

^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.

¹ A 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.

² El 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	10 – 14 ene.				17 - 21 ene.				24 - 28 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	99	136	7283	7960	35	132	4814	5390	27	163	4733	4370
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4890	3736	0	0	3148	1804	0	0	2580	2014
Otros ^c	136	99	1103	1371	132	35	1100	1798	163	27	575	1443
Total	235	235	13276	13067	167	167	9062	8992	190	190	7888	7827

^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.