

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de enero de 2022
Fecha de Información: 12 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\$5259 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.35%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	1507,6	831,1	69,4	985,0	284,4	45,3	477,3
15-35	1046,1	2319,2	1458,8	240,9	124,0	68,9	736,4
36-60	44,0	68,4	10,0	0,0	48,4	34,0	10,0
61-90	313,4	177,1	90,0	84,3	47,1	189,1	40,0
91-180	32,0	105,5	45,0	25,0	60,5	7,0	0,0
>180	43,5	54,7	27,4	20,0	7,3	3,5	20,0
Total	2986,6	3556,0	1700,5	1355,2	571,8	347,7	1283,7

^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	3.90%		3.19%	Inf%	3.97%
15-35	4.90%		4.25%	4.84%	4.50%
36-60	4.86%		4.88%	4.94%	4.90%
61-90	4.79%		4.95%	4.57%	4.70%
91-180	—		4.90%	4.30%	4.85%
>180	4.89%		5.17%	4.91%	4.99%
Total	4.53%		4.17%	4.45%	4.35%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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	81	104	6967	7157	35	140	5226	5637	28	178	4822	4528
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4244	3825	0	0	3202	2090	0	0	2622	2017
Otros ^c	104	81	949	989	140	35	1176	1808	178	28	629	1463
Total	185	185	12160	11971	175	175	9604	9535	206	206	8073	8008

^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.