

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2022
Fecha de Información: 13 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\$4487 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.60%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	742,4	774,0	476,9	521,5	107,0	30,9	190,1
15-35	1034,9	1409,8	1125,5	787,0	117,1	0,0	247,8
36-60	30,4	105,1	39,2	0,0	65,8	0,0	30,4
61-90	319,6	224,3	116,2	254,0	63,2	0,0	65,6
91-180	18,3	79,1	0,0	0,0	77,1	0,0	18,3
>180	215,9	176,4	80,0	125,0	11,4	0,0	90,9
Total	2361,5	2768,7	1837,8	1687,5	441,5	30,9	643,1

^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	4.17%		4.19%	Inf%	4.35%
15-35	4.80%		4.65%	4.21%	4.55%
36-60	—		5.00%	4.61%	4.87%
61-90	4.91%		4.99%	4.89%	4.92%
91-180	5.00%		5.14%	4.72%	5.06%
>180	5.11%		5.11%	5.03%	5.07%
Total	4.62%		4.64%	4.54%	4.60%

^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	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	57	54	5763	5735	46	151	5635	5827	28	189	4901	5085
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3272	3199	0	0	3246	2417	0	0	2929	2017
Otros ^c	54	57	851	861	151	46	1247	1814	189	28	802	1465
Total	111	111	9886	9795	197	197	10128	10058	217	217	8632	8567

^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.