INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 13 de diciembre de 2021[1]

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$3176 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.57%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	750,3	275,6	118,5	664,0	93,6	22,7	63,5
15-35	682,2	1334,8	900,2	268,1	41,0	20,5	393,6
36-60	92,9	79,1	35,5	0,0	17,3	66,6	26,3
61-90	195,8	61,0	34,5	50,0	6,5	125,8	20,0
91-180	13,4	44,2	0,2	0,0	44,0	13,4	0,0
>180	86,3	139,7	61,5	1,5	2,2	8,8	76,0
Total	**1820,8**	**1934,4**	**1150,5**	**983,6**	**204,5**	**257,7**	**579,4**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	4.52%	4.87%	3.94%	4.12%
15-35	4.78%	5.03%	4.49%	4.89%
36-60	4.56%	4.49%	4.48%	4.50%
61-90	4.31%	4.32%	4.26%	4.27%
91-180	–	4.34%	4.15%	4.29%
>180	4.63%	4.44%	4.20%	4.54%
Total	**4.71%**	**4.92%**	**4.12%**	**4.57%**

[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

	13 – 17 dic.				20 - 24 dic.				27 - 31 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	194	196	10126	12411	26	121	2549	3718	30	112	3764	5399
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	7875	5152	0	0	2367	1221	0	10	4277	2626
Otros[c]	196	194	2343	2681	121	26	315	255	112	20	300	267
Total	**390**	**390**	**20344**	**20244**	**147**	**147**	**5231**	**5194**	**142**	**142**	**8341**	**8292**

[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.