INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 17 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$1574 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.15%[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	381,1	56,8	38,5	354,9	14,3	22,2	4
15-35	259,7	657,1	562,6	178,2	22,5	9,5	72
36-60	4,6	92,1	74,1	0,0	18,0	4,6	0
61-90	21,7	110,5	76,0	0,5	19,5	6,2	15
91-180	6,6	13,6	0,0	0,0	13,6	6,6	0
>180	54,6	26,3	0,0	6,0	6,3	28,6	20
Total	**728,3**	**956,4**	**751,2**	**539,6**	**94,2**	**77,7**	**111**

[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	4.87%	4.78%	2.53%	2.86%
15-35	4.96%	4.70%	4.84%	4.75%
36-60	–	4.75%	4.27%	4.65%
61-90	4.48%	4.63%	4.37%	4.59%
91-180	–	4.85%	4.27%	4.66%
>180	5.15%	5.03%	4.78%	4.94%
Total	**4.93%**	**4.71%**	**3.29%**	**4.15%**

[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]	9	47	529	827	42	127	3057	3945	39	112	3995	5680
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	561	209	0	0	2510	1623	0	10	4433	2727
Otros[c]	47	9	69	109	127	42	328	291	112	29	306	279
Total	**56**	**56**	**1159**	**1145**	**169**	**169**	**5895**	**5859**	**151**	**151**	**8734**	**8686**

[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.