INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 24 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$522 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.18%[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	167,5	116,2	70	106	15,0	30,3	31,2
15-35	77,4	116,4	66	30	7,2	4,2	43,2
36-60	27,7	39,8	0	0	12,8	0,7	27,0
61-90	12,0	23,8	0	0	11,8	0,0	12,0
91-180	21,1	17,2	0	0	2,2	6,1	15,0
>180	30,2	0,8	0	30	0,8	0,2	0,0
Total	**335,8**	**314,3**	**136**	**166**	**49,9**	**41,4**	**128,4**

[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	4.20%	4.35%	3.86%	4.07%
15-35	4.12%	4.23%	4.12%	4.17%
36-60	4.25%	4.12%	3.56%	4.19%
61-90	4.17%	4.07%	–	4.12%
91-180	4.37%	2.66%	4.54%	4.25%
>180	–	4.78%	4.80%	4.80%
Total	**4.20%**	**4.22%**	**4.14%**	**4.18%**

[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

	20 – 24 dic.				27 - 31 dic.				03 - 07 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	1	4	119	192	31	144	4744	5965	25	82	3341	5119
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	107	48	0	10	4589	3317	0	0	3840	1984
Otros[c]	4	1	21	6	144	21	335	328	82	25	219	216
Total	**5**	**5**	**247**	**246**	**175**	**175**	**9668**	**9610**	**107**	**107**	**7400**	**7319**

[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.