INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de enero de 2022
Fecha de Información: 30 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$1074 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.28%[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	106,5	34,6	7,0	94,4	27,6	12,1	0
15-35	436,5	330,9	203,3	343,8	54,6	19,7	73
36-60	2,7	39,0	3,5	0,0	35,5	2,7	0
61-90	15,3	67,5	32,0	0,0	35,5	15,3	0
91-180	17,4	52,0	12,0	0,0	30,0	7,4	10
>180	6,8	47,9	0,0	0,0	47,9	6,8	0
Total	**585,2**	**571,8**	**257,8**	**438,2**	**231,0**	**64,0**	**83**

[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	–	4.33%	6.28%	4.16%
15-35	4.16%	4.31%	3.72%	4.15%
36-60	–	4.25%	3.77%	4.22%
61-90	–	4.27%	4.03%	4.19%
91-180	4.15%	4.34%	4.00%	4.25%
>180	–	5.20%	4.40%	5.10%
Total	**4.16%**	**4.45%**	**3.95%**	**4.28%**

[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

	27 – 31 dic.				03 - 07 ene.				10 - 14 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	9	27	581	762	28	87	3601	5322	68	115	5046	6866
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	457	325	0	0	3927	2152	0	0	4735	2103
Otros[c]	27	9	73	23	87	28	258	226	115	68	645	1284
Total	**36**	**36**	**1111**	**1110**	**115**	**115**	**7786**	**7700**	**183**	**183**	**10426**	**10253**

[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.