

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de enero de 2022
Fecha de Información: 17 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\$410 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.56%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	196,2	174,4	5,0	20,2	0,4	7,0	169
15-35	113,9	133,4	34,6	12,5	0,7	3,4	98
36-60	12,1	17,0	2,6	0,0	5,4	3,1	9
61-90	4,6	6,0	0,0	0,0	6,0	4,6	0
91-180	1,9	21,5	0,0	0,1	21,5	1,8	0
>180	2,0	2,7	0,9	0,0	1,8	2,0	0
Total	330,8	355,0	43,2	32,8	35,8	22,0	276

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.08%	4.47%	3.44%	2.33%
15-35	4.78%	4.77%	4.75%	4.77%
36-60	4.98%	5.16%	4.35%	4.92%
61-90	—	5.25%	4.79%	5.05%
91-180	—	5.03%	4.73%	5.01%
>180	—	5.35%	4.64%	4.97%
Total	3.13%	4.91%	3.99%	3.56%

^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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	17 – 21 ene.				24 - 28 ene.				31 ene. - 04 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	65	158	5942	6271	30	187	5039	5256	22	107	5553	8055
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3255	2563	0	0	2991	2039	0	0	6204	3144
Otros ^c	158	65	1539	1813	187	30	813	1482	107	22	335	841
Total	223	223	10736	10647	217	217	8843	8777	129	129	12092	12040

^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.