

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2022

Fecha de Información: 19 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\$3870 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.74%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1252,2	617,1	264,7	935,5	87,5	51,8	264,9
15-35	942,4	1235,9	692,7	331,6	76,5	144,2	466,7
36-60	111,3	50,4	2,0	26,8	28,4	64,6	20,0
61-90	50,4	103,3	75,0	36,0	18,3	4,4	10,0
91-180	64,3	167,1	123,1	55,0	43,5	8,8	0,5
>180	31,7	5,5	0,0	30,0	5,5	1,7	0,0
Total	2452,4	2179,4	1157,5	1414,8	259,8	275,5	762,0

^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	4.70%	3.90%	4.48%	4.46%
15-35	4.94%	4.91%	4.84%	4.91%
36-60	5.01%	5.01%	4.92%	4.96%
61-90	4.96%	5.06%	4.86%	5.03%
91-180	4.89%	5.15%	4.90%	5.11%
>180	—	5.56%	4.63%	5.34%
Total	4.86%	4.79%	4.62%	4.74%

^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	108	4825	4889	32	191	5808	5550	26	109	5921	8448
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2794	2392	0	0	3046	2546	0	0	6308	3402
Otros ^c	108	65	1037	1317	191	32	868	1557	109	26	535	863
Total	173	173	8656	8598	223	223	9722	9653	135	135	12764	12713

^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.