

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2022
Fecha de Información: 24 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\$2127 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.27%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	559,4	189,0	76,6	433,0	11,4	25,4	101,0
15-35	677,0	768,6	378,0	230,9	39,1	94,5	351,5
36-60	68,4	82,0	15,0	10,0	22,0	13,4	45,0
61-90	84,0	17,2	0,0	67,0	7,2	7,0	10,0
91-180	25,4	68,4	40,0	25,0	28,4	0,4	0,0
>180	94,3	1,3	0,0	85,0	1,3	9,3	0,0
Total	1508,4	1126,5	509,6	851,0	109,4	150,0	507,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	3.84%		4.33%	4.00%	4.01%
15-35	4.31%		4.32%	4.19%	4.28%
36-60	4.42%		4.47%	4.29%	4.40%
61-90	4.59%		4.74%	4.55%	4.58%
91-180	—		4.91%	4.91%	4.91%
>180	—		5.24%	5.04%	5.07%
Total	4.23%		4.46%	4.19%	4.27%

^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	24 – 28 ene.				31 ene. - 04 feb.				07 - 11 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	36	214	6616	6069	25	115	6443	8735	39	147	5665	6341
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3236	3206	0	0	6428	3759	0	0	3666	1997
Otros ^c	214	36	1062	1565	115	25	565	886	147	39	399	1266
Total	250	250	10914	10840	140	140	13436	13380	186	186	9730	9604

^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.