

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2022
Fecha de Información: 25 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\$2753 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.10%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	368,2	682,4	175,5	209,9	358,0	9,4	148,9
15-35	691,0	608,5	243,8	316,9	25,3	34,7	339,4
36-60	89,0	91,5	38,0	22,4	18,5	31,6	35,0
61-90	91,2	75,3	40,0	20,0	10,3	46,2	25,0
91-180	359,6	65,1	6,6	0,3	24,4	325,2	34,1
>180	197,1	61,7	12,0	137,0	4,7	15,1	45,0
Total	1796,1	1584,5	515,9	706,5	441,3	462,3	627,4

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.40%		2.62%	4.45%	3.37%
15-35	4.44%		4.48%	4.34%	4.43%
36-60	4.53%		4.63%	4.34%	4.48%
61-90	4.57%		4.67%	4.02%	4.32%
91-180	4.78%		4.93%	4.56%	4.61%
>180	4.89%		5.29%	4.88%	4.95%
Total	4.49%		3.31%	4.47%	4.10%

^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.

¹A 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.

²El 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

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	28	185	5284	5429	25	114	6560	8797	39	148	5747	6396
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2829	2630	0	0	6469	3853	0	0	3686	2041
Otros ^c	185	28	1087	1068	114	25	566	890	148	39	400	1269
Total	213	213	9200	9127	139	139	13595	13540	187	187	9833	9706

^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.