

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2022
Fecha de Información: 26 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\$2437 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.32%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	705,1	346,4	113,5	437,3	28,3	63,3	204,6
15-35	662,4	629,1	295,9	441,0	132,6	20,9	200,5
36-60	52,0	81,6	0,2	0,0	59,5	30,2	21,8
61-90	20,0	110,2	2,0	0,0	93,2	5,0	15,0
91-180	15,4	184,8	49,7	0,0	135,1	15,4	0,0
>180	52,7	34,5	0,0	33,9	19,5	3,8	15,0
Total	1507,6	1386,5	461,4	912,1	468,2	138,6	456,9

^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	4.32%	3.71%	4.09%	4.09%
15-35	4.31%	4.32%	4.24%	4.29%
36-60	4.28%	4.66%	4.29%	4.49%
61-90	4.53%	4.69%	4.49%	4.66%
91-180	—	4.78%	4.66%	4.77%
>180	5.17%	5.28%	5.03%	5.14%
Total	4.35%	4.42%	4.21%	4.32%

^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	26	157	4524	4532	25	122	7063	8906	37	155	5768	6408
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2215	2186	0	0	6491	4253	0	0	3695	2063
Otros ^c	157	26	973	932	122	25	571	909	155	37	403	1269
Total	183	183	7712	7650	147	147	14125	14068	192	192	9866	9740

^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.