

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de febrero de 2022
Fecha de Información: 28 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\$2424 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.05%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	406,4	403,8	243,8	344,4	109,8	11,9	50,2
15-35	534,5	822,9	512,4	299,6	163,5	87,9	147,0
36-60	61,7	48,5	1,0	0,0	47,5	61,7	0,0
61-90	224,0	60,5	22,8	135,8	2,7	53,2	35,0
91-180	7,1	29,9	0,0	0,0	24,3	1,5	5,6
>180	47,1	15,8	10,0	45,0	5,8	2,1	0,0
Total	1280,8	1381,4	790,0	824,8	353,7	218,2	237,8

^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	4.18%		3.64%	3.08%	3.47%
15-35	4.13%		4.27%	4.27%	4.25%
36-60	—		4.50%	4.23%	4.35%
61-90	4.44%		4.51%	4.34%	4.36%
91-180	4.61%		4.92%	4.56%	4.85%
>180	—		5.15%	4.84%	4.97%
Total	4.20%		4.11%	3.95%	4.05%

^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	18	57	593	386	27	136	7980	9614	42	160	6048	6609
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	43	207	0	0	7037	5056	0	0	3779	2210
Otros ^c	57	18	161	187	136	27	670	960	160	42	405	1286
Total	75	75	797	780	163	163	15687	15630	202	202	10232	10105

^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.