

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de febrero de 2022
Fecha de Información: 31 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\$2091 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.50%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	514,1	548,0	243,0	314,6	116,1	10,4	189,0
15-35	493,0	594,1	284,6	229,0	79,8	34,4	229,6
36-60	207,6	43,5	0,0	70,4	28,5	122,2	15,0
61-90	25,4	49,2	0,0	0,0	29,2	5,4	20,0
91-180	7,4	33,0	0,0	0,0	33,0	7,4	0,0
>180	3,9	25,3	0,8	0,0	24,4	3,9	0,0
Total	1251,4	1293,1	528,4	614,0	311,0	183,7	453,6

^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%	4.16%	4.17%	4.32%
15-35	4.58%	4.65%	4.39%	4.58%
36-60	4.66%	4.76%	4.56%	4.60%
61-90	4.83%	4.63%	4.40%	4.68%
91-180	—	4.89%	4.96%	4.90%
>180	—	5.25%	4.76%	5.18%
Total	4.65%	4.52%	4.34%	4.50%

^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	31 ene. - 04 feb.				07 - 11 feb.				14 - 18 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	27	137	8262	9960	46	163	6164	6864	23	170	4562	6171
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	7158	5214	0	0	3879	2292	0	0	3947	1972
Otros ^c	137	27	778	959	163	46	530	1289	170	23	759	1058
Total	164	164	16198	16133	209	209	10573	10445	193	193	9268	9201

^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.