

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de febrero de 2022
Fecha de Información: 01 de febrero 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\$2481 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.56%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	415,9	341,1	222,3	238,9	22,8	81,0	96,0
15-35	719,0	721,8	364,9	420,3	72,4	14,1	284,5
36-60	91,7	132,0	0,0	58,2	102,0	3,4	30,0
61-90	130,4	177,3	70,0	70,0	52,3	5,4	55,0
91-180	26,3	71,8	5,1	25,0	66,7	1,3	0,0
>180	38,9	81,2	65,2	37,0	15,0	0,9	1,0
Total	1422,3	1525,3	727,5	849,5	331,2	106,3	466,5

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.47%	4.79%	3.80%	4.10%
15-35	4.66%	4.45%	4.64%	4.57%
36-60	4.67%	4.83%	4.69%	4.78%
61-90	4.87%	5.01%	4.78%	4.94%
91-180	—	5.11%	4.79%	5.10%
>180	4.99%	5.46%	5.41%	5.43%
Total	4.65%	4.71%	4.23%	4.56%

^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	29	128	6921	8184	46	169	6335	7030	23	174	4624	6186
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5876	4223	0	0	3938	2329	0	0	3948	1994
Otros ^c	128	29	467	790	169	46	537	1325	174	23	763	1083
Total	157	157	13264	13197	215	215	10810	10684	197	197	9335	9263

^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.