

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de febrero de 2022
Fecha de Información: 04 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\$1763 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.33%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	498,0	379,9	126,8	306,3	99,4	38,0	153,7
15-35	191,6	621,7	543,4	85,9	30,6	58,0	47,7
36-60	62,1	7,8	0,0	24,0	7,8	38,0	0,0
61-90	42,4	61,0	20,0	25,0	31,0	7,4	10,0
91-180	10,1	25,6	0,0	4,9	25,6	5,2	0,0
>180	68,5	65,6	0,0	2,4	5,6	6,2	60,0
Total	872,6	1161,6	690,2	448,4	199,9	152,8	271,4

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.41%	11.29%	4.19%	6.01%
15-35	4.75%	4.67%	4.61%	4.67%
36-60	—	4.83%	4.68%	4.71%
61-90	4.92%	4.96%	4.78%	4.88%
91-180	—	5.19%	4.91%	5.14%
>180	5.52%	5.36%	4.89%	5.45%
Total	4.73%	6.40%	4.38%	5.33%

^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	3	38	606	922	47	179	7549	8065	24	176	5463	6870
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	574	235	0	0	4230	3089	0	0	4396	2447
Otros ^c	38	3	90	108	179	47	911	1379	176	24	779	1229
Total	41	41	1270	1265	226	226	12690	12533	200	200	10638	10546

^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.