

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de febrero de 2022
Fecha de Información: 07 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\$2579 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.66%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	333,9	724,9	277,2	237,5	380,7	29,4	67,0
15-35	734,9	379,8	174,4	409,7	21,3	141,2	184,1
36-60	170,8	18,2	0,0	0,0	8,2	160,8	10,0
61-90	36,0	155,0	137,0	20,0	3,0	1,0	15,0
91-180	228,8	100,0	40,0	40,0	10,0	138,8	50,0
>180	6,4	16,3	15,3	0,0	1,1	6,4	0,0
Total	1510,9	1394,2	643,9	707,2	424,2	477,7	326,1

^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	5.06%	3.79%	4.84%	4.14%
15-35	4.97%	5.05%	4.89%	4.95%
36-60	5.01%	5.21%	4.89%	4.92%
61-90	5.21%	5.20%	5.11%	5.17%
91-180	5.60%	5.52%	5.20%	5.35%
>180	—	5.70%	5.22%	5.46%
Total	5.10%	4.20%	4.94%	4.66%

^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	07 – 11 feb.				14 - 18 feb.				21 - 25 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	43	184	7810	8485	29	174	5527	7175	54	167	7984	7220
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4456	3315	0	0	4475	2477	0	0	4250	3777
Otros ^c	184	43	1081	1390	174	29	985	1243	167	54	814	2006
Total	227	227	13347	13190	203	203	10987	10895	221	221	13048	13003

^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.