

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2022
Fecha de Información: 10 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\$3726 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.97%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	380,6	308,3	105,6	233,5	68,6	13,0	134,1
15-35	1525,5	1005,6	504,4	1019,6	65,3	69,9	436,0
36-60	18,0	111,8	29,5	0,0	80,3	16,0	2,0
61-90	60,3	85,2	0,6	35,6	64,6	4,7	20,0
91-180	227,8	274,0	14,2	82,0	114,8	0,8	145,0
>180	305,5	212,8	140,0	251,0	20,8	2,5	52,0
Total	2517,7	1997,7	794,3	1621,7	414,3	106,9	789,1

^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	4.79%	4.97%	Inf%	4.52%
15-35	4.57%	4.64%	4.72%	4.64%
36-60	4.86%	5.16%	4.94%	5.12%
61-90	5.07%	5.38%	5.12%	5.25%
91-180	5.49%	5.89%	5.13%	5.57%
>180	6.35%	6.30%	6.32%	6.32%
Total	4.90%	5.09%	4.90%	4.97%

^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	31	83	4536	4625	32	181	6015	7840	55	175	8233	7819
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2720	2396	0	0	4755	2800	0	0	4665	3850
Otros ^c	83	31	371	536	181	32	1248	1263	175	55	865	2035
Total	114	114	7627	7557	213	213	12018	11903	230	230	13763	13704

^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.