

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2022
Fecha de Información: 14 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\$2971 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.07%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	809,8	392,2	250,5	656,4	10,7	22,4	131,0
15-35	590,2	981,9	695,5	215,1	50,4	139,1	236,0
36-60	32,2	45,3	0,0	10,0	25,3	2,2	20,0
61-90	119,1	42,2	7,0	92,5	15,2	6,6	20,0
91-180	71,3	87,5	32,7	30,0	14,0	0,5	40,9
>180	111,7	180,6	123,0	65,0	12,6	1,7	45,0
Total	1734,3	1729,8	1108,7	1069,0	128,3	172,4	492,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.44%		3.72%	3.05%	3.41%
15-35	4.45%		4.30%	4.36%	4.35%
36-60	4.62%		4.82%	4.18%	4.71%
61-90	5.14%		5.16%	4.70%	5.09%
91-180	5.62%		5.70%	5.47%	5.58%
>180	6.02%		6.35%	5.80%	6.14%
Total	4.72%		4.27%	3.47%	4.07%

^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	14 – 18 feb.				21 - 25 feb.				28 feb. - 04 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	193	6976	8503	43	176	8674	8308	22	155	4015	5536
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4937	3518	0	0	4935	4030	0	0	3553	1851
Otros ^c	192	33	1494	1272	176	43	905	2097	155	22	484	634
Total	226	226	13407	13293	219	219	14514	14435	177	177	8052	8021

^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.