

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2022
Fecha de Información: 15 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\$3770 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.02%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	922,6	533,0	424,2	774,7	4,6	43,7	104,2
15-35	1077,0	1304,3	778,3	473,7	59,0	136,4	467,0
36-60	20,5	227,6	212,4	5,0	7,1	7,5	8,1
61-90	43,6	75,6	29,6	20,0	26,0	3,6	20,0
91-180	35,4	38,1	10,0	32,4	26,5	1,4	1,6
>180	75,0	21,3	15,0	60,0	3,3	12,0	3,0
Total	2174,2	2199,9	1469,4	1365,8	126,6	204,6	603,9

^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	4.55%		4.42%	2.99%	3.56%
15-35	4.53%		3.48%	4.46%	4.02%
36-60	4.47%		4.84%	4.38%	4.55%
61-90	5.19%		5.24%	5.12%	5.19%
91-180	5.36%		5.77%	5.51%	5.62%
>180	6.14%		6.38%	6.26%	6.28%
Total	4.57%		3.90%	3.80%	4.02%

^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.

¹A 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.

²El 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	32	168	6632	7580	41	175	8853	8481	23	156	4188	5672
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4615	3608	0	0	5100	4196	0	0	3611	1909
Otros ^c	167	32	1167	1129	175	41	906	2102	156	23	496	669
Total	200	200	12414	12317	216	216	14859	14779	179	179	8295	8250

^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.