

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2022
Fecha de Información: 16 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\$3483 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.48%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	476,0	569,3	384,1	366,0	118,7	43,4	66,6
15-35	549,2	904,4	671,9	287,9	56,9	85,8	175,6
36-60	295,7	207,1	110,0	178,0	6,6	27,2	90,5
61-90	207,5	248,3	101,4	80,0	31,9	12,5	115,0
91-180	132,9	71,1	31,4	8,4	19,2	104,0	20,5
>180	210,9	113,4	70,0	170,0	8,4	5,9	35,0
Total	1872,2	2113,7	1368,8	1090,3	241,6	278,7	503,3

^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	4.54%	3.59%	4.02%	3.89%
15-35	4.47%	4.08%	4.43%	4.25%
36-60	4.67%	4.73%	3.49%	4.24%
61-90	5.15%	5.09%	5.09%	5.11%
91-180	5.43%	5.45%	5.29%	5.35%
>180	6.30%	6.28%	6.23%	6.26%
Total	4.84%	4.27%	4.51%	4.48%

^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	28	148	5915	6402	42	175	8925	8824	23	156	4280	5744
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4126	3468	0	0	5413	4235	0	0	3631	1938
Otros ^c	147	28	882	971	175	42	916	2114	156	23	516	698
Total	176	176	10923	10841	217	217	15254	15173	179	179	8427	8380

^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.