

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2022
Fecha de Información: 17 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\$2923 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.25%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	538,3	350,2	107,6	441,0	169,1	23,9	73,5
15-35	625,9	945,8	631,2	332,3	75,9	54,9	238,7
36-60	31,6	23,1	3,5	25,0	16,1	3,1	3,5
61-90	244,1	139,6	20,1	130,0	10,5	5,1	109,0
91-180	200,3	125,2	53,0	50,0	42,3	120,3	30,0
>180	65,3	103,3	25,0	10,0	63,3	40,3	15,0
Total	1705,5	1687,3	840,5	988,3	377,2	247,6	469,7

^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	4.45%	2.13%	3.92%	3.41%
15-35	4.42%	4.12%	4.34%	4.24%
36-60	4.33%	4.80%	4.26%	4.61%
61-90	4.68%	5.05%	4.62%	4.68%
91-180	5.07%	5.80%	4.90%	5.10%
>180	6.36%	6.44%	6.33%	6.39%
Total	4.59%	3.94%	4.39%	4.25%

^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	9	104	3907	4213	42	177	9157	9146	24	155	4318	5770
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2466	1966	0	0	5519	4382	0	0	3636	1973
Otros ^c	104	9	608	731	177	42	1063	2129	155	24	537	702
Total	113	113	6981	6910	219	219	15739	15657	179	179	8491	8445

^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.