

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2022
Fecha de Información: 18 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\$2817 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.96%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	379,2	687,5	160,5	271,8	450,1	30,6	76,9
15-35	677,7	523,4	258,4	416,4	37,2	33,3	227,9
36-60	21,0	35,0	0,0	0,0	15,0	1,0	20,0
61-90	95,3	159,2	75,0	20,0	14,2	5,3	70,0
91-180	429,2	62,8	0,0	6,5	62,8	422,7	0,0
>180	87,5	76,3	25,0	43,0	29,3	22,5	22,0
Total	1689,9	1544,3	518,9	757,7	608,6	515,3	416,8

^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	4.40%		1.97%	3.32%	2.46%
15-35	4.39%		4.51%	4.28%	4.38%
36-60	4.30%		4.78%	4.31%	4.50%
61-90	4.71%		4.76%	4.63%	4.73%
91-180	—		5.34%	4.86%	4.92%
>180	6.12%		6.38%	6.13%	6.21%
Total	4.53%		3.15%	4.54%	3.96%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	56	703	759	44	182	9436	9747	25	157	4416	5840
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	428	316	0	0	5624	4569	0	0	3685	2063
Otros ^c	56	9	166	220	182	44	1498	2154	157	25	551	703
Total	65	65	1297	1295	226	226	16558	16470	182	182	8652	8606

^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.