

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2022
Fecha de Información: 21 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\$836 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.59%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	410,6	341,2	162,6	198	13,5	47,6	165
15-35	50,5	149,8	90,0	34	53,8	10,5	6
36-60	4,9	7,7	0,0	0	7,7	4,9	0
61-90	2,2	2,9	0,0	0	2,9	2,2	0
91-180	30,1	36,8	0,0	0	6,8	0,1	30
>180	0,0	0,2	0,0	0	0,2	0,0	0
Total	498,3	538,6	252,6	232	84,9	65,3	201

^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	3.69%	4.29%	2.01%	3.17%
15-35	4.29%	3.97%	4.33%	4.06%
36-60	—	4.65%	4.31%	4.52%
61-90	—	5.09%	4.74%	4.93%
91-180	5.48%	5.31%	4.72%	5.44%
>180	—	6.25%	—	6.25%
Total	3.97%	4.16%	2.55%	3.59%

^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	21 – 25 feb.				28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	181	9794	10011	25	156	4464	5867	47	148	5987	5693
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5783	4786	0	0	3705	2103	0	0	3296	2841
Otros ^c	181	47	1506	2197	156	25	551	703	148	47	707	1107
Total	228	228	17083	16994	181	181	8720	8673	195	195	9990	9641

^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.