

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2022
Fecha de Información: 23 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\$2779 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.07%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	807,3	421,3	150,6	621,5	128,3	43,3	142,5
15-35	661,0	896,3	475,8	302,2	97,3	35,5	323,2
36-60	132,5	112,5	25,0	0,0	46,5	91,5	41,0
61-90	18,8	79,0	1,7	0,0	65,3	6,8	12,0
91-180	10,4	60,3	10,0	8,0	50,3	2,4	0,0
>180	8,7	95,0	60,0	0,0	30,0	3,7	5,0
Total	1638,6	1664,4	723,0	931,8	417,7	183,1	523,8

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.26%	4.07%	3.17%	3.55%
15-35	4.20%	4.10%	4.14%	4.14%
36-60	4.56%	4.63%	4.34%	4.49%
61-90	5.01%	4.94%	4.75%	4.94%
91-180	—	5.71%	5.30%	5.64%
>180	6.43%	6.18%	5.83%	6.18%
Total	4.29%	4.42%	3.60%	4.07%

^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	44	146	8546	8724	26	164	5082	6312	54	153	6273	6265
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5034	4460	1	0	3885	2545	0	0	3678	2954
Otros ^c	146	44	1423	1755	164	26	722	782	153	54	754	1131
Total	190	190	15003	14939	191	190	9689	9639	207	207	10705	10350

^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.