INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2022
Fecha de Información: 27 de enero de 2022[1]

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$4076 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.78%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1094,6	450,8	339,4	919,5	8,5	72,1	103,0
15-35	716,7	1319,3	1070,0	516,4	83,2	34,2	166,2
36-60	3,2	113,1	85,0	1,0	28,1	2,1	0,0
61-90	276,8	133,8	0,0	80,0	28,8	91,8	105,0
91-180	4,8	124,3	8,9	0,0	114,3	3,8	1,0
>180	155,8	88,2	30,0	120,0	28,2	5,8	30,0
Total	**2251,9**	**2229,6**	**1533,3**	**1637,0**	**291,2**	**209,7**	**405,2**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	3.97%	4.24%	2.69%	2.98%
15-35	4.09%	3.87%	4.01%	3.92%
36-60	–	4.60%	4.03%	4.56%
61-90	4.42%	4.66%	4.24%	4.34%
91-180	4.58%	4.83%	4.36%	4.82%
>180	4.86%	5.09%	4.87%	4.93%
Total	**4.20%**	**4.08%**	**3.33%**	**3.78%**

[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: ((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

	24 – 28 ene.				31 ene. - 04 feb.				07 - 11 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	27	103	3658	3599	25	132	7716	9293	37	157	5896	6470
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1668	1909	0	0	6815	4797	0	0	3725	2144
Otros[c]	103	27	875	670	132	25	570	956	157	37	405	1285
Total	**130**	**130**	**6201**	**6178**	**157**	**157**	**15101**	**15046**	**194**	**194**	**10026**	**9899**

[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.