

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de febrero de 2022
Fecha de Información: 02 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\$3567 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.52%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1163,9	590,3	193,8	723,4	60,9	105,0	335,5
15-35	746,4	1366,1	764,0	173,2	39,8	11,0	562,2
36-60	88,8	175,2	35,5	5,0	109,7	53,8	30,0
61-90	154,6	97,9	28,6	90,0	23,8	19,1	45,5
91-180	17,3	30,9	4,9	0,0	26,0	17,3	0,0
>180	68,6	108,0	20,0	0,0	20,0	0,6	68,0
Total	2239,6	2368,3	1046,9	991,6	280,2	206,8	1041,2

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	4.53%		4.56%	4.23%	4.36%
15-35	4.57%		4.54%	4.50%	4.55%
36-60	4.68%		4.56%	4.56%	4.58%
61-90	4.81%		4.99%	4.79%	4.83%
91-180	-		5.16%	4.78%	5.03%
>180	5.16%		5.31%	4.46%	5.20%
Total	4.61%		4.60%	4.34%	4.52%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	31 ene. - 04 feb.				07 - 11 feb.				14 - 18 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	32	112	6091	6676	45	171	6719	7400	23	176	5021	6578
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4857	3948	0	0	4021	2437	0	0	4251	2204
Otros ^c	112	32	403	668	171	45	590	1346	176	23	770	1166
Total	144	144	11351	11292	216	216	11330	11183	199	199	10042	9948

^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.