

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de febrero de 2022
Fecha de Información: 03 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\$5510 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.23%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	1387,0	956,7	457,6	1067,8	244,9	64,9	254,2
15-35	1108,3	2147,8	1510,3	414,5	16,4	72,8	621,0
36-60	143,6	31,1	0,0	91,6	31,1	52,0	0,0
61-90	235,2	40,8	0,0	210,0	20,8	5,2	20,0
91-180	100,6	90,9	20,0	40,0	45,9	35,6	25,0
>180	141,3	181,0	45,0	0,0	2,0	7,3	134,0
Total	3115,9	3448,3	2032,9	1823,9	361,2	237,7	1054,2

^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	4.50%		4.69%	3.41%	3.87%
15-35	4.71%		4.03%	4.57%	4.30%
36-60	-		5.06%	4.68%	4.82%
61-90	4.75%		5.26%	4.70%	4.83%
91-180	4.86%		4.99%	4.91%	4.93%
>180	5.20%		5.24%	4.90%	5.20%
Total	4.72%		4.28%	3.77%	4.23%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	14	62	5010	5279	45	171	7197	7922	24	175	5422	6748
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3762	3300	0	0	4209	2786	0	0	4291	2436
Otros ^c	62	14	288	440	171	45	824	1366	175	24	775	1211
Total	76	76	9060	9019	216	216	12230	12074	199	199	10488	10395

^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.