

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2022
Fecha de Información: 08 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\$2842 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.44%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	463,4	408,8	325,4	424,5	58,4	13,8	25,0
15-35	491,6	710,7	588,4	329,1	19,2	59,4	103,1
36-60	154,4	135,8	65,3	5,9	16,3	94,3	54,2
61-90	314,6	74,6	10,0	251,1	9,6	8,5	55,0
91-180	70,1	58,8	30,0	65,0	28,7	5,1	0,0
>180	127,5	159,1	65,0	30,0	4,1	7,5	90,0
Total	1621,6	1547,8	1084,2	1105,6	136,3	188,6	327,3

^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	4.86%		4.64%	4.71%	4.68%
15-35	4.88%		6.97%	4.83%	6.02%
36-60	5.04%		5.12%	4.92%	4.99%
61-90	5.32%		5.36%	5.32%	5.32%
91-180	-		5.47%	5.63%	5.55%
>180	6.00%		5.83%	5.75%	5.90%
Total	5.29%		5.97%	4.97%	5.44%

^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	07 – 11 feb.				14 - 18 feb.				21 - 25 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	150	6545	7159	31	174	5622	7532	52	170	8025	7382
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3955	3050	0	0	4646	2537	0	0	4383	3783
Otros ^c	150	47	814	996	174	31	1147	1248	170	52	823	2020
Total	197	197	11314	11205	205	205	11415	11317	222	222	13231	13185

^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.