INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2022
Fecha de Información: 22 de febrero 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$4205 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.12%[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	861,4	980,6	560,9	632,9	245,5	54,3	174,2
15-35	964,6	979,6	673,0	684,7	75,7	49,0	230,9
36-60	334,4	94,6	0,7	183,0	64,4	121,9	29,5
61-90	190,8	61,8	30,0	70,0	21,8	110,8	10,0
91-180	28,9	43,8	5,0	18,0	28,8	0,9	10,0
>180	85,4	48,3	25,0	70,0	0,0	0,4	15,0
Total	**2465,6**	**2208,8**	**1294,6**	**1658,6**	**436,3**	**337,3**	**469,6**

[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	4.32%	3.21%	3.83%	3.66%
15-35	4.13%	3.96%	4.27%	4.08%
36-60	4.60%	4.69%	4.47%	4.54%
61-90	5.09%	5.11%	4.97%	5.02%
91-180	5.45%	5.47%	5.35%	5.43%
>180	6.35%	6.22%	6.38%	6.34%
Total	**4.35%**	**3.85%**	**4.30%**	**4.12%**

[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

	21 – 25 feb.				28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	58	181	10451	10640	27	165	4771	6149	54	149	6202	6150
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	6095	5260	0	0	3865	2331	0	0	3628	2953
Otros[c]	181	58	1654	2202	164	27	640	744	149	54	747	1118
Total	**239**	**239**	**18200**	**18102**	**191**	**192**	**9276**	**9224**	**203**	**203**	**10577**	**10221**

[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.