

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2022
Fecha de Información: 24 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\$2178 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.17%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	349,0	391,7	170,1	218,7	165,6	74,3	56,0
15-35	521,2	520,3	314,5	296,6	52,3	71,1	153,5
36-60	291,2	28,7	0,4	143,0	21,2	141,2	7,0
61-90	33,1	59,8	0,0	30,0	59,8	3,1	0,0
91-180	87,3	113,7	10,0	10,0	78,7	52,3	25,0
>180	12,6	13,0	10,0	10,0	1,0	0,6	2,0
Total	1294,4	1127,3	505,0	708,3	378,7	342,6	243,5

^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	4.05%		3.24%	4.02%	3.73%
15-35	4.09%		4.23%	3.80%	4.05%
36-60	4.22%		4.86%	4.37%	4.43%
61-90	-		4.95%	4.57%	4.93%
91-180	4.98%		5.27%	5.08%	5.15%
>180	5.81%		6.45%	6.46%	6.40%
Total	4.19%		4.19%	4.14%	4.17%

^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	21 – 25 feb.				28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	41	109	7364	7184	27	168	5414	6890	74	155	6391	6273
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4067	3969	1	0	4287	2808	0	0	3683	3006
Otros ^c	109	41	1200	1406	167	27	876	827	155	74	758	1198
Total	150	150	12631	12559	195	195	10577	10525	229	229	10832	10477

^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.