INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2022
Fecha de Información: 14 de enero 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$2979 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.24%[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	306,5	499,5	65,9	144,0	303,6	32,5	130,0
15-35	1084,4	1242,6	806,9	485,1	34,7	198,3	401,0
36-60	88,3	31,4	0,0	8,0	26,4	75,3	5,0
61-90	25,8	48,9	20,0	0,0	13,9	10,8	15,0
91-180	7,2	32,6	0,0	0,0	32,6	7,2	0,0
>180	113,8	56,5	40,0	0,0	9,0	106,3	7,5
Total	**1625,9**	**1911,5**	**932,8**	**637,2**	**420,3**	**430,3**	**558,5**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.01%	3.63%	0.28%	3.21%
15-35	4.95%	4.57%	4.11%	4.49%
36-60	4.70%	5.10%	4.60%	4.73%
61-90	4.91%	4.99%	4.78%	4.93%
91-180	–	5.14%	4.50%	5.03%
>180	5.00%	5.18%	4.86%	4.91%
Total	**4.96%**	**4.33%**	**3.71%**	**4.24%**

[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

	10 – 14 ene.				17 - 21 ene.				24 - 28 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	21	26	1411	1262	59	155	5761	6173	28	187	4967	5188
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	451	537	0	0	3250	2477	0	0	2991	2039
Otros[c]	26	21	276	324	155	59	1537	1820	187	28	813	1478
Total	**47**	**47**	**2138**	**2123**	**214**	**214**	**10548**	**10470**	**215**	**215**	**8771**	**8705**

[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.