INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2022
Fecha de Información: 20 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$4083 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.58%[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	608,3	567,5	211,1	443,4	206,3	14,8	150,1
15-35	1206,8	766,3	457,3	841,1	43,8	100,5	265,2
36-60	262,0	23,5	0,0	17,5	23,5	244,5	0,0
61-90	73,0	40,5	0,0	0,0	25,5	58,0	15,0
91-180	227,4	458,7	335,0	110,0	68,7	62,4	55,0
>180	193,1	231,5	130,0	80,0	11,5	23,1	90,0
Total	**2570,7**	**2088,1**	**1133,4**	**1492,0**	**379,4**	**503,4**	**575,3**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	4.62%	3.02%	4.70%	4.04%
15-35	4.72%	4.76%	4.73%	4.73%
36-60	–	5.08%	4.57%	4.62%
61-90	4.76%	4.96%	4.90%	4.89%
91-180	4.86%	5.01%	4.69%	4.88%
>180	5.44%	5.51%	5.22%	5.37%
Total	**4.82%**	**4.21%**	**4.72%**	**4.58%**

[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

	17 – 21 ene.				24 - 28 ene.				31 ene. - 04 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	54	59	3407	3263	33	199	6179	5863	25	111	6028	8557
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1950	1747	0	0	3094	2828	0	0	6334	3437
Otros[c]	59	54	524	835	199	33	1050	1562	111	25	547	864
Total	**113**	**113**	**5881**	**5845**	**232**	**232**	**10323**	**10253**	**136**	**136**	**12909**	**12858**

[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.