INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2022
Fecha de Información: 21 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$1808 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.38%[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	278,2	224,8	172,4	262,3	44,4	7,9	8
15-35	685,7	296,3	133,0	486,1	72,3	108,6	91
36-60	32,4	111,0	38,3	5,7	72,6	26,7	0
61-90	5,2	57,7	0,0	0,0	57,7	5,2	0
91-180	5,0	93,0	0,0	0,0	93,0	5,0	0
>180	86,8	90,8	20,0	20,0	10,8	6,8	60
Total	**1093,3**	**873,5**	**363,7**	**774,1**	**350,8**	**160,2**	**159**

[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	4.47%	4.03%	2.45%	3.26%
15-35	4.40%	4.43%	4.37%	4.39%
36-60	–	4.75%	4.31%	4.64%
61-90	–	4.80%	4.47%	4.77%
91-180	–	4.92%	4.71%	4.91%
>180	5.35%	5.29%	5.17%	5.33%
Total	**4.77%**	**4.58%**	**4.10%**	**4.38%**

[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]	47	20	575	746	36	213	6349	5950	25	115	6092	8668
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	504	224	0	0	3167	2997	0	0	6428	3492
Otros[c]	20	47	72	181	213	36	1064	1564	115	25	561	865
Total	**67**	**67**	**1151**	**1151**	**249**	**249**	**10580**	**10511**	**140**	**140**	**13081**	**13025**

[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.