INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de marzo de 2022
Fecha de Información: 07 de marzo 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$3501 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.27%[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	666,3	786,1	205,3	484,1	437,7	39,1	143,0
15-35	654,4	679,0	407,6	416,6	97,4	63,8	174,0
36-60	181,7	57,9	18,0	40,0	24,5	126,3	15,4
61-90	107,0	27,5	0,0	0,0	14,4	93,9	13,1
91-180	363,8	276,8	135,0	35,0	86,8	273,8	55,0
>180	30,4	90,2	65,0	10,0	5,2	0,4	20,0
Total	**2003,6**	**1917,5**	**830,9**	**985,8**	**666,1**	**597,3**	**420,5**

[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	4.48%	2.71%	3.57%	3.30%
15-35	4.52%	4.54%	4.48%	4.51%
36-60	4.94%	4.80%	4.33%	4.47%
61-90	5.11%	5.00%	5.07%	5.07%
91-180	5.17%	5.35%	5.01%	5.15%
>180	6.05%	6.30%	5.72%	6.18%
Total	**4.70%**	**4.06%**	**4.34%**	**4.27%**

[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

	07 – 11 mar.				14 - 18 mar.				21 - 25 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	86	199	7925	8270	28	249	7373	9235	47	186	3128	2704
Intragrupo y off-shore[b]	1	0	4386	3714	0	0	5471	3309	0	0	1126	1337
Otros[c]	198	86	1520	1469	249	28	2004	2168	186	47	665	843
Total	**285**	**285**	**13831**	**13453**	**277**	**277**	**14848**	**14712**	**233**	**233**	**4919**	**4884**

[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.