INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2022
Fecha de Información: 14 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$2165 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.71%[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	479,2	521,7	178,7	219,3	156,0	72,8	187,0
15-35	537,2	650,2	342,4	203,5	69,9	95,8	237,9
36-60	155,3	86,5	44,3	6,7	42,0	148,4	0,2
61-90	2,5	27,1	0,0	0,0	27,1	2,5	0,0
91-180	22,3	57,9	12,2	2,7	45,7	19,6	0,0
>180	30,5	19,6	0,0	0,0	19,6	30,5	0,0
Total	**1227,1**	**1363,1**	**577,6**	**432,3**	**360,4**	**369,7**	**425,1**

[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	4.78%	4.53%	3.70%	4.34%
15-35	4.84%	4.87%	4.69%	4.79%
36-60	4.99%	5.04%	4.94%	4.97%
61-90	–	5.25%	5.00%	5.22%
91-180	–	5.82%	5.36%	5.68%
>180	–	6.36%	6.12%	6.21%
Total	**4.81%**	**4.86%**	**4.50%**	**4.71%**

[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

	14 – 18 mar.				21 - 25 mar.				28 mar. - 01 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	70	245	9271	10685	50	184	3998	3265	41	219	4795	4901
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	6239	4670	0	0	1347	1941	0	0	2608	2704
Otros[c]	245	70	2354	2341	184	50	860	945	219	41	946	696
Total	**315**	**315**	**17864**	**17696**	**234**	**234**	**6205**	**6151**	**260**	**260**	**8349**	**8301**

[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.