INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2022
Fecha de Información: 15 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$2908 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.27%[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	540,8	405,3	244,8	477,4	141,0	43,9	19,5
15-35	487,5	845,4	731,5	347,9	65,9	91,5	48,0
36-60	167,2	63,9	1,4	0,0	62,4	167,2	0,0
61-90	5,3	14,9	1,0	0,0	14,0	5,3	0,0
91-180	133,6	187,7	140,0	100,0	17,7	3,6	30,0
>180	67,8	106,1	80,0	40,0	6,1	7,8	20,0
Total	**1402,1**	**1623,3**	**1198,7**	**965,3**	**307,0**	**319,3**	**117,5**

[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	4.72%	4.80%	6.31%	5.67%
15-35	4.71%	4.86%	4.65%	4.81%
36-60	–	5.04%	4.74%	4.82%
61-90	–	5.54%	5.22%	5.45%
91-180	5.47%	5.86%	5.69%	5.67%
>180	6.47%	6.44%	6.25%	6.37%
Total	**5.20%**	**4.96%**	**5.64%**	**5.27%**

[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

	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]	48	217	4959	5837	51	190	4121	3618	41	223	4854	5007
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	3648	2642	0	0	1539	2016	0	0	2690	2734
Otros[c]	217	48	970	985	190	51	989	960	223	41	966	721
Total	**265**	**265**	**9577**	**9464**	**241**	**241**	**6649**	**6594**	**264**	**264**	**8510**	**8462**

[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.