INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de marzo de 2022
Fecha de Información: 18 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$1548 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.54%[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	180,2	173,5	96,7	84,7	37,6	56,3	39,2
15-35	399,8	558,9	354,0	233,5	62,9	24,3	142,0
36-60	8,1	13,4	0,0	1,4	13,4	6,8	0,0
61-90	38,4	71,8	41,0	6,8	5,8	6,7	25,0
91-180	157,5	107,7	65,6	88,0	7,0	34,4	35,1
>180	44,0	47,3	30,0	31,8	5,8	0,8	11,5
Total	**828,0**	**972,5**	**587,3**	**446,1**	**132,5**	**129,1**	**252,8**

[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	4.80%	5.18%	1.05%	3.22%
15-35	4.78%	4.73%	4.72%	4.74%
36-60	–	5.31%	4.76%	5.13%
61-90	5.09%	5.45%	5.21%	5.17%
91-180	5.77%	6.21%	5.75%	5.79%
>180	6.28%	6.85%	6.39%	6.43%
Total	**5.02%**	**4.90%**	**3.74%**	**4.54%**

[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]	11	53	1039	1122	55	204	4693	4421	39	223	5301	5656
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	893	804	0	0	1873	2249	0	0	3054	2852
Otros[c]	53	11	128	126	204	55	1205	1041	223	39	1005	799
Total	**64**	**64**	**2060**	**2052**	**259**	**259**	**7771**	**7711**	**262**	**262**	**9360**	**9307**

[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.