

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de marzo de 2022
Fecha de Información: 25 de febrero de 2022¹

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\$3105 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.83%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	616,2	571,8	194,0	488,5	326,9	76,7	51,0
15-35	636,0	665,7	403,9	418,7	97,3	52,8	164,5
36-60	111,2	60,6	10,0	56,2	50,5	54,9	0,1
61-90	21,0	72,8	10,8	0,0	51,5	10,5	10,5
91-180	260,7	120,1	17,5	30,0	89,1	217,2	13,5
>180	128,5	82,2	70,0	126,0	9,7	0,0	2,5
Total	1773,6	1573,3	706,2	1119,4	624,9	412,0	242,1

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.13%	2.10%	3.21%	2.66%
15-35	4.20%	4.33%	4.02%	4.17%
36-60	4.44%	4.54%	4.40%	4.48%
61-90	4.42%	4.81%	4.41%	4.71%
91-180	5.09%	5.37%	4.85%	5.00%
>180	6.02%	6.25%	5.99%	6.12%
Total	4.26%	3.52%	4.04%	3.83%

^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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ { (365 / \text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	21 – 25 feb.				28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	20	54	1746	1802	32	153	5825	7183	73	158	6512	6541
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1030	793	1	0	4457	3159	0	0	3705	3065
Otros ^c	54	20	220	371	153	32	976	866	158	73	974	1231
Total	74	74	2996	2966	186	185	11258	11208	231	231	11191	10837

^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.