

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de marzo de 2022
Fecha de Información: 28 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\$2574 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.00%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	438,7	206,6	105,1	292,7	24,2	68,8	77,2
15-35	615,6	920,2	616,0	324,2	45,7	32,9	258,5
36-60	154,6	118,1	20,5	105,0	56,2	8,2	41,4
61-90	40,0	28,0	0,0	0,0	28,0	40,0	0,0
91-180	161,4	141,1	50,0	159,9	91,1	1,5	0,0
>180	83,5	46,4	11,6	66,6	31,8	13,9	3,0
Total	1493,8	1460,4	803,3	948,4	277,0	165,3	380,1

^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	3.96%	3.19%	3.18%	3.32%
15-35	4.02%	3.93%	3.87%	3.95%
36-60	4.43%	4.34%	3.88%	4.34%
61-90	—	4.98%	4.49%	4.69%
91-180	—	5.44%	5.02%	5.36%
>180	6.30%	6.24%	6.13%	6.21%
Total	4.07%	4.28%	3.64%	4.00%

^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	28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.				14 - 18 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	158	6088	7309	74	161	6603	6616	21	210	6393	7950
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4553	3380	1	0	3741	3067	0	0	5235	2717
Otros ^c	157	33	978	877	160	74	983	1289	210	21	1199	2062
Total	191	191	11619	11566	235	235	11327	10972	231	231	12827	12729

^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.