

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de marzo de 2022
Fecha de Información: 01 de marzo 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\$2976 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.04%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	854,2	704,8	279,6	470,2	237,2	196,1	188,0
15-35	521,5	575,7	408,8	376,4	36,7	14,8	130,3
36-60	88,5	105,3	1,2	0,0	104,1	88,5	0,0
61-90	23,7	52,9	20,0	9,1	32,9	14,6	0,0
91-180	198,8	131,9	10,0	168,0	91,9	0,8	30,0
>180	31,5	35,6	10,0	30,0	25,6	1,5	0,0
Total	1718,3	1606,1	729,6	1053,7	528,3	316,3	348,3

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	3.98%		3.59%	3.86%	3.79%
15-35	3.95%		3.99%	3.89%	3.96%
36-60	—		4.23%	3.97%	4.11%
61-90	—		4.78%	4.74%	4.77%
91-180	4.94%		5.29%	5.44%	5.24%
>180	—		6.06%	5.63%	5.95%
Total	4.05%		4.12%	3.95%	4.04%

^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	24	106	5098	6000	75	163	6780	6998	22	214	6550	8133
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3908	2831	1	0	3895	3102	0	0	5304	2809
Otros ^c	106	24	590	716	163	75	1172	1392	214	22	1265	2071
Total	130	130	9596	9547	239	238	11847	11492	236	236	13119	13013

^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.