

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de marzo de 2022
Fecha de Información: 02 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\$4083 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.43%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	612,5	453,0	195,0	398,2	53,0	9,3	205,0
15-35	722,9	915,8	625,7	579,6	154,3	7,5	135,8
36-60	4,0	194,3	137,4	1,5	56,9	2,5	0,0
61-90	216,1	108,2	6,0	211,7	102,2	4,4	0,0
91-180	505,7	450,7	25,0	239,3	160,7	1,4	265,0
>180	364,1	162,0	90,0	271,3	51,8	72,6	20,1
Total	2425,3	2284,0	1079,2	1701,6	578,9	97,8	625,9

^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	4.11%		4.01%	3.24%	3.67%
15-35	3.77%		4.13%	4.29%	4.14%
36-60	—		4.51%	4.16%	4.50%
61-90	—		4.72%	4.48%	4.66%
91-180	4.92%		5.42%	4.93%	5.08%
>180	5.65%		6.01%	5.68%	5.81%
Total	4.43%		4.61%	4.23%	4.43%

^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.

¹A 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.

²El 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

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	27	92	4239	4780	75	176	6933	7220	21	229	6746	8349
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3124	2380	1	0	3951	3107	0	0	5405	2910
Otros ^c	92	27	500	653	176	75	1193	1395	229	21	1287	2074
Total	119	119	7863	7813	252	251	12077	11722	250	250	13438	13333

^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.