

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de marzo de 2022
Fecha de Información: 04 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\$4238 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.93%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	697,3	914,0	199,5	339,4	489,5	132,9	225
15-35	912,4	1107,3	518,6	352,7	120,6	91,7	468
36-60	96,1	57,4	0,7	87,8	56,7	8,4	0
61-90	56,7	77,1	35,7	37,4	26,4	4,2	15
91-180	662,6	346,9	36,1	65,0	120,8	407,6	190
>180	160,8	147,0	0,0	60,0	47,0	0,8	100
Total	2585,9	2649,7	790,6	942,3	861,0	645,7	998

^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	4.27%	2.04%	2.01%	2.48%
15-35	4.24%	4.25%	4.26%	4.25%
36-60	—	4.76%	4.30%	4.70%
61-90	4.62%	4.95%	4.55%	4.75%
91-180	5.13%	5.07%	4.82%	4.94%
>180	6.29%	6.00%	5.84%	6.15%
Total	4.63%	3.43%	3.86%	3.93%

^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	14	38	1005	1086	85	187	7580	7912	23	246	7077	8766
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	786	635	1	0	4148	3452	0	0	5465	3085
Otros ^c	38	14	64	124	187	85	1463	1461	246	23	1569	2139
Total	52	52	1855	1845	273	272	13191	12825	269	269	14111	13990

^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.