

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2022
Fecha de Información: 08 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\$3467 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.91%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	675,7	557,4	259,1	502,2	142,3	17,5	156,0
15-35	754,7	907,5	659,0	409,9	44,6	140,7	204,0
36-60	207,2	140,4	21,5	104,2	23,9	8,0	95,0
61-90	32,6	44,3	1,5	27,0	42,7	5,6	0,0
91-180	112,0	247,5	103,1	40,9	100,9	27,6	43,5
>180	233,4	192,3	37,0	93,0	15,3	0,4	140,0
Total	2015,6	2089,5	1081,2	1177,3	369,7	199,8	638,5

^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	4.74%		4.56%	4.54%	4.58%
15-35	4.71%		4.71%	4.52%	4.65%
36-60	5.01%		5.15%	4.71%	4.98%
61-90	—		5.32%	5.03%	5.19%
91-180	5.50%		5.75%	5.27%	5.59%
>180	6.68%		6.03%	6.62%	6.54%
Total	5.25%		4.91%	4.69%	4.91%

^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	07 – 11 mar.				14 - 18 mar.				21 - 25 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	87	172	7140	7107	30	256	7705	9496	48	187	3171	2811
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	3912	3588	0	0	5564	3526	0	0	1213	1337
Otros ^c	171	87	1191	1178	256	30	2080	2172	187	48	675	856
Total	259	259	12243	11873	286	286	15349	15194	235	235	5059	5004

^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.