

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2022
Fecha de Información: 09 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\$4349 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.53%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	1024,1	413,2	172,0	794,9	77,2	65,2	164,0
15-35	806,5	1466,6	1154,0	518,8	51,8	27,0	260,8
36-60	90,4	70,1	0,0	45,0	70,1	45,4	0,0
61-90	505,1	66,5	20,0	500,0	46,5	5,1	0,0
91-180	109,6	115,9	4,8	60,0	100,7	39,2	10,4
>180	60,6	105,8	0,0	10,0	55,8	0,6	50,0
Total	2596,3	2238,1	1350,8	1928,7	402,1	182,4	485,2

^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	4.67%	2.81%	4.58%	3.94%
15-35	4.69%	4.56%	4.58%	4.59%
36-60	—	5.14%	4.24%	4.78%
61-90	—	5.50%	5.02%	5.42%
91-180	5.44%	5.94%	5.30%	5.69%
>180	6.85%	6.51%	6.79%	6.68%
Total	4.92%	4.69%	4.25%	4.53%

^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	81	149	6150	5638	30	260	8169	9738	49	188	3321	2911
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2963	3011	0	0	5689	3883	0	0	1273	1444
Otros ^c	148	81	919	1026	260	30	2132	2213	188	49	684	869
Total	230	230	10032	9675	290	290	15990	15834	237	237	5278	5224

^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.