

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2022
Fecha de Información: 17 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\$2885 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.66%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	958,7	941,2	469,5	538,2	99,8	48,5	372,0
15-35	377,8	558,3	400,0	281,4	76,3	14,4	82,0
36-60	134,6	66,4	46,5	46,7	11,8	79,8	8,1
61-90	47,0	100,0	46,0	12,8	24,0	4,2	30,0
91-180	60,7	58,2	10,0	35,0	23,2	0,7	25,0
>180	74,7	34,5	10,0	60,0	14,5	4,7	10,0
Total	1653,4	1758,6	982,0	974,0	249,6	152,3	527,1

^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	4.68%		4.30%	72846.36%	4.44%
15-35	4.62%		4.73%	4.61%	4.68%
36-60	4.80%		5.04%	4.90%	4.91%
61-90	5.05%		5.59%	5.31%	5.29%
91-180	5.46%		5.99%	4.81%	5.40%
>180	6.27%		6.62%	6.66%	6.61%
Total	4.76%		4.58%	4.70%	4.66%

^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	14 – 18 mar.				21 - 25 mar.				28 mar. - 01 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	39	104	2825	3007	51	195	4578	4259	39	222	5242	5579
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1960	1671	0	0	1781	2236	0	0	3030	2836
Otros ^c	104	39	506	572	195	51	1187	992	222	39	991	794
Total	143	143	5291	5250	246	246	7546	7487	261	261	9263	9209

^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.