

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2022
Fecha de Información: 22 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\$2195 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.10%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	281,8	424,9	194	69,1	107,4	89,2	123,5
15-35	885,9	590,1	112	568,4	179,2	18,6	298,9
36-60	87,3	52,0	0	20,0	44,7	60,0	7,3
61-90	44,7	29,3	0	0,2	29,3	44,5	0,0
91-180	20,6	106,2	45	0,0	61,2	20,6	0,0
>180	93,0	51,6	0	30,0	8,6	20,0	43,0
Total	1413,3	1254,0	351	687,6	430,3	252,9	472,8

^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	4.86%		4.93%	4.88%	4.89%
15-35	4.88%		4.95%	4.83%	4.88%
36-60	4.25%		5.25%	5.03%	5.07%
61-90	—		5.65%	5.20%	5.38%
91-180	—		6.08%	5.75%	6.01%
>180	6.96%		6.88%	6.81%	6.88%
Total	5.05%		5.17%	5.08%	5.10%

^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	21 - 25 mar.				28 mar. - 01 abr.				04 - 08 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	58	200	4791	4592	39	225	5468	5803	28	198	5552	6291
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2008	2296	0	0	3094	2896	0	0	4264	2997
Otros ^c	200	58	1209	1053	225	39	1080	883	198	28	522	999
Total	258	258	8008	7941	264	264	9642	9582	226	226	10338	10287

^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.