

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de marzo de 2022
Fecha de Información: 23 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\$1720 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.98%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	213,5	283,3	198,5	184,1	60,8	5,5	24
15-35	602,1	380,5	209,4	421,8	25,2	34,3	146
36-60	11,6	20,6	4,3	6,0	16,2	5,6	0
61-90	49,6	109,3	71,4	19,6	27,9	20,0	10
91-180	56,1	104,9	0,6	0,0	49,3	1,1	55
>180	64,6	78,9	37,3	25,3	21,6	19,3	20
Total	997,5	977,5	521,5	656,7	201,0	85,9	255

^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	4.89%	4.90%	4.75%	4.83%
15-35	4.92%	4.87%	4.46%	4.68%
36-60	—	5.31%	4.94%	5.16%
61-90	5.11%	4.88%	4.98%	4.92%
91-180	5.73%	6.46%	5.57%	6.07%
>180	6.94%	6.77%	6.54%	6.75%
Total	5.26%	5.18%	4.64%	4.98%

^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	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	54	149	3274	3146	39	225	5510	5996	28	201	5646	6326
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1400	1689	0	0	3199	2897	0	0	4273	3070
Otros ^c	149	54	914	699	225	39	1133	889	201	28	528	1000
Total	203	203	5588	5534	264	264	9842	9782	229	229	10447	10396

^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.