

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de marzo de 2022
Fecha de Información: 25 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\$2361 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.72%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	395,8	289,5	164,2	239,0	60,3	91,8	65,0
15-35	681,6	536,1	264,3	413,9	19,4	15,4	252,4
36-60	65,6	149,7	0,0	0,0	149,7	65,6	0,0
61-90	13,2	238,7	185,2	2,4	53,5	10,8	0,0
91-180	86,6	98,3	5,0	20,0	28,3	1,6	65,0
>180	121,3	81,7	42,3	95,7	24,4	10,5	15,0
Total	1364,0	1393,9	661,0	771,0	335,6	195,6	397,4

^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	4.94%	4.87%	4.08%	4.47%
15-35	4.91%	4.34%	4.89%	4.73%
36-60	—	5.10%	4.95%	5.05%
61-90	—	3.30%	5.30%	3.52%
91-180	5.70%	6.13%	5.57%	5.78%
>180	6.67%	1.57%	6.57%	5.23%
Total	5.11%	4.48%	4.73%	4.72%

^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	25	55	595	558	48	229	5826	6581	31	210	6178	6568
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	124	266	0	0	3566	3068	0	0	4476	3365
Otros ^c	55	25	237	131	229	48	1261	945	210	31	536	1208
Total	80	80	956	955	277	277	10653	10594	241	241	11190	11141

^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.