

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2022
Fecha de Información: 28 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\$2152 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.38%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	285,4	378,9	349,9	206,5	17,0	66,9	12,0
15-35	422,7	295,4	191,8	373,1	84,5	30,6	19,1
36-60	197,8	285,4	130,0	38,0	15,4	19,8	140,0
61-90	70,8	49,0	0,0	0,0	9,0	30,8	40,0
91-180	161,0	66,6	0,0	133,7	39,6	0,2	27,0
>180	173,9	148,5	0,0	0,0	3,5	28,9	145,0
Total	1311,6	1223,8	671,7	751,3	169,1	177,2	383,1

^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	4.13%		4.73%	4.74%	4.72%
15-35	4.85%		4.43%	4.75%	4.59%
36-60	5.07%		5.17%	5.04%	5.07%
61-90	20.86%		5.47%	5.28%	13.11%
91-180	5.52%		6.16%	4.71%	5.33%
>180	6.33%		6.88%	6.48%	6.37%
Total	7.19%		4.75%	4.87%	5.38%

^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	28 mar. - 01 abr.				04 - 08 abr.				11 - 15 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	48	229	5826	6581	31	210	6178	6568	14	132	3656	4398
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3566	3068	0	0	4476	3365	1	0	3090	2039
Otros ^c	229	48	1261	945	210	31	536	1208	131	14	486	775
Total	277	277	10653	10594	241	241	11190	11141	146	146	7232	7212

^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.