

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2022
Fecha de Información: 29 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\$4378 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.31%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	257,2	507,1	219,2	64,1	206,8	111,9	81,2
15-35	707,1	950,8	565,9	390,6	121,0	52,6	263,9
36-60	433,0	573,6	285,0	0,0	33,6	178,0	255,0
61-90	29,8	40,4	10,1	9,0	10,3	0,8	20,0
91-180	194,1	921,1	0,0	180,0	911,1	4,1	10,0
>180	386,7	7,2	0,2	380,0	7,0	6,7	0,0
Total	2007,9	3000,3	1080,4	1023,7	1289,8	354,1	630,1

^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	4.89%		4.83%	4.13%	4.64%
15-35	4.84%		3.34%	4.75%	4.02%
36-60	5.06%		5.11%	4.99%	5.04%
61-90	36.72%		5.64%	4.81%	25.60%
91-180	5.90%		6.39%	5.69%	6.38%
>180	—		6.55%	5.99%	6.00%
Total	5.96%		5.15%	5.18%	5.31%

^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	43	187	5624	6353	36	213	6236	6746	17	165	3664	4407
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3664	2979	0	0	4533	3379	1	0	3090	2039
Otros ^c	187	43	1067	968	213	36	617	1210	164	17	487	775
Total	230	230	10355	10300	249	249	11386	11335	182	182	7241	7221

^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.