

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de abril de 2022
Fecha de Información: 30 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\$1481 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.70%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	327,5	211,4	81,4	197,5	0	0	130
15-35	354,7	608,0	391,0	137,7	0	0	217
36-60	21,8	20,0	0,0	1,8	0	0	20
91-180	75,0	0,0	0,0	75,0	0	0	0
>180	120,0	120,0	110,0	110,0	0	0	10
Total	899,0	959,4	582,4	522,0	0	0	377

^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	3.12%		4.34%	4.27%	3.68%
15-35	4.88%		4.84%	4.81%	4.86%
36-60	5.06%		—	—	5.06%
91-180	—		—	5.49%	5.49%
>180	6.26%		6.66%	6.40%	6.41%
Total	4.32%		4.82%	5.21%	4.70%

^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	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	37	141	4839	5194	36	213	6328	6844	17	165	3686	4407
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2931	2563	0	0	4558	3386	1	0	3090	2061
Otros ^c	141	37	806	777	213	36	617	1210	164	17	487	775
Total	178	178	8576	8534	249	249	11503	11440	182	182	7263	7243

^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.