

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2022
Fecha de Información: 24 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\$2562 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.96%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	311,4	173,6	61,5	188,4	64,2	75,0	48,0
15-35	1008,7	771,2	581,0	870,6	69,2	17,1	121,0
36-60	68,2	43,7	26,2	0,0	8,8	59,5	8,6
61-90	107,9	124,1	20,0	14,1	19,1	8,8	85,0
91-180	39,8	55,0	0,0	5,0	21,5	1,3	33,5
>180	79,6	75,3	73,0	75,2	2,3	4,4	0,0
Total	1615,6	1242,9	761,7	1153,3	185,1	166,1	296,2

^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	4.90%		4.43%	4.41%	4.48%
15-35	4.92%		4.97%	4.38%	4.79%
36-60	4.87%		5.23%	4.90%	4.93%
61-90	5.06%		5.40%	5.18%	5.15%
91-180	5.78%		6.16%	5.68%	5.90%
>180	-		6.73%	6.77%	6.75%
Total	5.05%		5.14%	4.70%	4.96%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	34	105	1915	1594	43	229	5576	6127	30	209	5838	6370
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	638	1060	0	0	3232	2927	0	0	4306	3143
Otros ^c	105	34	484	342	229	43	1197	892	209	30	528	1109
Total	139	139	3037	2996	272	272	10005	9946	239	239	10672	10622

^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.