

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de abril de 2022
Fecha de Información: 04 de abril 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\$3636 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.76%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	322,4	542,2	147,3	243,1	378,4	62,7	16,5
15-35	850,1	863,9	481,5	471,3	58,9	55,3	323,5
36-60	487,5	279,9	64,0	17,6	60,7	314,7	155,2
61-90	161,2	154,7	50,0	50,4	39,7	45,8	65,0
91-180	8,6	98,2	10,0	0,0	88,2	8,6	0,0
>180	348,9	152,8	20,0	262,8	58,8	12,1	74,0
Total	2178,7	2091,7	772,8	1045,3	684,7	499,3	634,2

^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	3.68%	2.55%	6.18%	3.06%
15-35	5.18%	5.09%	5.12%	5.14%
36-60	5.28%	5.35%	4.58%	4.89%
61-90	5.40%	5.44%	5.10%	5.32%
91-180	—	5.97%	5.41%	5.92%
>180	6.30%	6.22%	5.99%	6.18%
Total	5.32%	4.13%	4.97%	4.76%

^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	04 – 08 abr.				11 - 15 abr.				18 - 22 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	53	224	7146	7764	29	168	4128	5092	83	250	5175	4483
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5005	3933	1	0	3278	2275	10	0	2180	2434
Otros ^c	224	53	875	1246	166	29	815	833	240	83	913	1232
Total	277	277	13026	12943	196	197	8221	8200	333	333	8268	8149

^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.