

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de abril de 2022
Fecha de Información: 06 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\$3096 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.42%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	625,8	370,8	223,7	510,1	55,4	23,9	91,7
15-35	854,8	1415,6	735,1	175,2	75,4	74,5	605,1
36-60	86,5	25,3	0,0	7,2	5,3	59,2	20,0
61-90	40,8	141,5	95,6	22,6	30,9	3,2	15,0
91-180	2,3	46,0	20,0	0,0	26,0	2,3	0,0
>180	147,4	161,2	50,4	55,0	20,8	2,4	90,0
Total	1757,7	2160,5	1124,8	770,2	213,8	165,7	821,8

^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	5.42%	5.35%	5.15%	5.26%
15-35	5.43%	5.36%	8.35%	5.38%
36-60	5.51%	5.39%	5.30%	5.36%
61-90	5.37%	5.45%	5.27%	5.43%
91-180	—	6.00%	5.68%	5.97%
>180	6.35%	6.22%	6.21%	6.29%
Total	5.53%	5.42%	5.27%	5.42%

^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	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	41	142	5213	5388	33	169	4355	5418	85	253	5328	4807
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3427	3139	1	0	3397	2470	10	0	2366	2462
Otros ^c	142	41	627	676	168	33	998	840	242	85	983	1289
Total	183	183	9267	9203	202	202	8750	8728	337	338	8677	8558

^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.