

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2022
Fecha de Información: 07 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\$2731 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.83%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	513,1	328,7	128,0	452,3	162,7	22,8	38,0
15-35	530,4	1091,2	788,2	118,5	60,0	168,9	243,0
36-60	176,1	20,6	0,0	0,0	10,6	166,1	10,0
61-90	132,1	52,6	1,2	83,8	6,4	3,3	45,0
91-180	1,1	51,0	40,0	0,0	11,0	1,1	0,0
>180	136,3	104,4	30,0	62,0	3,8	3,7	70,5
Total	1489,2	1648,5	987,5	716,6	254,5	366,0	406,5

^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	5.37%	3.00%	4.07%	3.66%
15-35	5.41%	5.27%	5.30%	5.31%
36-60	5.35%	5.86%	4.17%	4.32%
61-90	5.37%	5.64%	5.37%	5.38%
91-180	—	6.04%	5.23%	5.97%
>180	6.28%	6.10%	6.16%	6.20%
Total	5.55%	4.63%	4.72%	4.83%

^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	34	101	3647	3819	33	170	4647	5453	89	254	5392	5354
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2592	2407	1	0	3410	2737	10	0	2721	2462
Otros ^c	101	34	363	349	169	33	999	844	244	89	1143	1306
Total	135	135	6602	6575	203	203	9056	9034	343	343	9256	9122

^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.