

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2022
Fecha de Información: 08 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\$2576 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.44%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	342,0	478,7	364,8	223,0	8,9	13,9	105,1
15-35	972,1	946,2	550,0	557,1	51,2	70,0	345,0
36-60	8,9	11,1	3,0	0,0	8,2	8,9	0,0
61-90	18,2	16,7	0,0	11,3	16,7	6,9	0,0
91-180	112,1	26,2	10,0	106,0	11,2	1,1	5,0
>180	59,2	54,9	35,0	20,0	4,9	24,2	15,0
Total	1512,5	1533,9	962,7	917,4	101,1	125,0	470,1

^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	5.31%	5.87%	5.01%	5.45%
15-35	5.37%	5.41%	5.35%	5.38%
36-60	—	5.65%	5.25%	5.47%
61-90	—	5.57%	5.24%	5.47%
91-180	5.49%	6.07%	5.50%	5.60%
>180	6.06%	6.18%	6.19%	6.16%
Total	5.38%	5.59%	5.33%	5.44%

^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	20	52	744	707	51	171	4945	5717	91	256	5497	5474
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	329	442	1	0	3597	2956	10	0	2791	2514
Otros ^c	52	20	153	57	169	51	1000	845	246	91	1150	1315
Total	72	72	1226	1206	221	222	9542	9518	347	347	9438	9303

^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.