

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2022
Fecha de Información: 12 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\$3272 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.51%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	471,2	364,3	241,5	390,7	64,1	21,8	58,7
15-35	661,4	1104,0	895,5	429,9	25,5	48,5	183,0
36-60	8,4	22,4	8,2	0,0	13,0	7,2	1,2
61-90	200,1	277,3	270,1	180,1	7,1	20,0	0,0
91-180	210,2	282,5	40,0	5,0	42,5	5,2	200,0
>180	96,6	106,8	2,0	2,2	14,8	4,4	90,0
Total	1647,9	2157,3	1457,4	1007,8	167,0	107,2	532,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.60%		5.67%	4.16%	4.86%
15-35	5.64%		5.63%	5.35%	5.59%
36-60	5.71%		5.67%	5.46%	5.62%
61-90	—		5.75%	5.55%	5.56%
91-180	5.62%		6.06%	5.68%	5.70%
>180	6.40%		6.32%	5.85%	6.36%
Total	5.76%		5.67%	5.01%	5.51%

^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	11 – 15 abr.				18 - 22 abr.				25 - 29 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	107	4612	4865	112	258	5750	5813	60	277	5435	5614
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	3350	3209	10	0	2978	2660	0	0	2994	2822
Otros ^c	106	31	561	411	248	112	1214	1334	277	60	949	867
Total	138	138	8523	8485	370	370	9942	9807	337	337	9378	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.