

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2022
Fecha de Información: 18 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\$2237 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.23%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	513,8	541,9	104,0	167,5	136,4	44,8	301,5
15-35	607,9	709,6	228,7	184,2	74,4	17,3	406,4
36-60	153,7	66,1	0,1	31,5	21,5	77,7	44,5
61-90	0,4	11,9	0,3	0,0	11,5	0,4	0,0
91-180	121,9	185,6	95,0	0,0	30,6	61,9	60,0
>180	75,0	107,0	56,0	30,0	6,0	0,0	45,0
Total	1472,7	1622,2	484,2	413,2	280,5	202,0	857,4

^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	5.59%	3.97%	4.84%	4.84%
15-35	5.31%	5.58%	5.47%	5.42%
36-60	5.59%	5.71%	4.92%	5.20%
61-90	—	5.71%	5.20%	5.69%
91-180	5.65%	5.82%	5.54%	5.67%
>180	6.18%	6.18%	6.10%	6.16%
Total	5.49%	4.99%	5.02%	5.23%

^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	18 – 22 abr.				25 - 29 abr.				02 - 06 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	114	267	6496	6316	63	282	5684	5849	18	143	7077	6915
Intragrupo y off-shore ^b	10	0	3168	3128	0	0	3108	2947	1	0	3867	3212
Otros ^c	257	114	1341	1426	282	63	974	885	142	18	586	1333
Total	381	381	11005	10870	345	345	9766	9681	161	161	11530	11460

^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.