

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2022
Fecha de Información: 20 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\$2937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.36%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	541,6	548,2	166,7	318,0	222,3	64,4	159,2
15-35	735,2	943,3	492,5	281,5	58,7	61,6	392,1
36-60	181,6	59,2	0,0	32,6	19,2	109,0	40,0
61-90	31,5	32,8	0,0	10,0	12,8	1,5	20,0
91-180	151,4	59,7	20,0	0,0	14,5	126,3	25,1
>180	179,3	235,0	90,0	50,1	20,0	4,2	125,0
Total	1820,6	1878,2	769,3	692,2	347,5	367,0	761,4

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.59%		5.63%	3.98%	4.91%
15-35	5.62%		5.39%	5.53%	5.50%
36-60	5.63%		5.65%	5.51%	5.55%
61-90	5.64%		5.73%	5.44%	5.67%
91-180	5.78%		5.99%	5.57%	5.64%
>180	6.16%		6.36%	5.82%	6.18%
Total	5.71%		5.52%	4.87%	5.36%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	57	166	5301	5300	68	283	5771	6187	20	145	7251	7445
Intragrupo y off-shore ^b	10	0	2927	2680	0	0	3220	2988	1	0	4212	3239
Otros ^c	156	57	826	960	283	68	1169	894	144	20	632	1341
Total	223	223	9054	8940	351	351	10160	10069	165	165	12095	12025

^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.