

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2022
Fecha de Información: 22 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\$1610 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.63%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	96,8	163,4	101,7	71,5	39,2	2,8	22,5
15-35	440,1	748,5	581,2	271,1	22,1	23,8	145,1
36-60	17,1	29,7	8,0	11,9	21,7	5,2	0,0
61-90	11,2	103,9	90,5	0,5	3,4	0,7	10,0
91-180	17,9	57,0	23,8	0,1	15,4	0,0	17,8
>180	111,0	78,8	1,2	40,0	7,5	1,0	70,0
Total	694,0	1181,3	806,4	395,1	109,4	33,5	265,4

^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	5.63%	5.76%	4.01%	5.30%
15-35	5.63%	5.66%	5.59%	5.64%
36-60	—	5.73%	5.51%	5.68%
61-90	5.63%	5.65%	5.54%	5.64%
91-180	5.78%	5.84%	5.24%	5.80%
>180	6.10%	6.17%	6.13%	6.12%
Total	5.76%	5.70%	5.32%	5.63%

^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	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	0	55	826	929	15	284	4748	6234	14	146	5831	7501
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	427	400	0	0	3222	2890	1	0	4180	3021
Otros ^c	55	0	79	3	284	15	1190	37	145	14	657	145
Total	55	55	1332	1332	299	299	9160	9161	160	160	10668	10667

^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.