

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2022
Fecha de Información: 25 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\$2014 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.88%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	220,0	238,1	155,0	163,6	62,6	35,9	20,5
15-35	378,2	540,4	405,2	201,1	19,0	60,8	116,2
36-60	187,2	86,6	17,2	65,2	28,4	81,0	41,0
61-90	28,1	10,7	0,0	0,0	10,7	28,1	0,0
91-180	151,2	277,9	139,7	44,5	58,5	26,9	79,8
>180	146,6	86,2	1,0	56,6	5,2	10,0	80,0
Total	1111,2	1240,0	718,1	531,0	184,5	242,7	337,5

^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	6.35%	5.84%	5.31%	5.65%
15-35	5.90%	5.86%	21.07%	5.81%
36-60	5.75%	5.88%	5.64%	5.72%
61-90	—	5.64%	5.53%	5.56%
91-180	5.79%	7.04%	5.70%	6.29%
>180	6.19%	6.30%	6.02%	6.13%
Total	5.95%	6.07%	5.60%	5.88%

^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	25 – 29 abr.				02 - 06 may.				09 - 13 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	119	284	6133	6601	26	146	7432	8007	106	213	3837	3419
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3497	3243	1	0	4659	3318	0	0	1706	1607
Otros ^c	284	119	1259	942	145	26	664	1360	213	106	381	833
Total	403	403	10889	10786	172	172	12755	12685	319	319	5924	5859

^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.