

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de abril de 2022**  
**Fecha de Información: 26 de abril de 2022<sup>1</sup>**

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\$3494 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.98%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	570,0	723,6	316,9	196,7	174,0	140,7	232,7
15-35	942,6	792,1	392,9	427,8	42,0	157,6	357,1
36-60	41,8	137,2	40,7	5,5	73,5	13,3	23,0
61-90	43,4	18,9	0,0	1,2	15,9	39,2	3,0
91-180	295,5	169,9	130,0	156,7	9,9	108,9	30,0
>180	232,1	313,1	140,0	84,8	33,1	7,3	140,0
<b>Total</b>	<b>2125,4</b>	<b>2154,7</b>	<b>1020,5</b>	<b>872,6</b>	<b>348,4</b>	<b>466,9</b>	<b>785,8</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.86%		6.34%	36.67%	6.08%
15-35	5.97%		5.98%	5.87%	5.94%
36-60	5.88%		5.93%	5.74%	5.90%
61-90	5.73%		5.94%	5.72%	5.78%
91-180	5.92%		6.05%	5.78%	5.82%
>180	5.95%		6.15%	6.01%	5.99%
<b>Total</b>	<b>5.93%</b>		<b>6.15%</b>	<b>5.84%</b>	<b>5.98%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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 <sup>a</sup>	115	233	5606	6037	27	146	7722	8443	115	213	3902	3499
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3352	3088	1	0	4776	3356	0	0	1736	1609
Otros <sup>c</sup>	233	115	1028	787	145	27	832	1462	213	115	401	845
<b>Total</b>	<b>348</b>	<b>348</b>	<b>9986</b>	<b>9912</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>13330</b>	<b>13261</b>	<b>328</b>	<b>328</b>	<b>6039</b>	<b>5953</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.