

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2022
Fecha de Información: 26 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\$3494 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.98%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
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
Total	2125,4	2154,7	1020,5	872,6	348,4	466,9	785,8

^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	5.86%	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%
Total	5.93%	6.15%	5.84%	5.98%

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

^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.