

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2022
Fecha de Información: 27 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\$3062 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.87%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	462,5	409,6	174,8	305,4	153,8	76,0	81,0
15-35	921,7	1001,6	539,5	467,1	77,8	70,3	384,2
36-60	192,2	69,3	0,5	32,7	68,8	159,5	0,0
61-90	86,5	141,8	55,0	0,0	6,8	6,5	80,0
91-180	115,8	147,0	50,0	4,1	42,0	56,7	55,0
>180	51,1	87,9	60,0	17,8	2,9	8,3	25,0
Total	1829,8	1857,2	879,8	827,2	352,2	377,4	625,2

^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	5.93%	5.71%	5.54%	5.65%
15-35	6.00%	5.94%	5.93%	5.96%
36-60	—	6.37%	5.89%	6.01%
61-90	5.94%	6.01%	5.80%	5.93%
91-180	5.87%	6.18%	5.76%	5.91%
>180	6.04%	6.06%	5.54%	5.98%
Total	5.97%	5.92%	5.74%	5.87%

^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	107	191	4516	5034	30	146	7957	8721	120	213	3930	3555
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2744	2355	1	0	4854	3519	0	0	1771	1625
Otros ^c	191	107	925	759	145	30	974	1471	213	120	423	858
Total	298	298	8185	8148	176	176	13785	13711	333	333	6124	6038

^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.