

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de mayo de 2022**

**Fecha de Información: 28 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\$2777 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.86%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	357,5	372,9	242,0	94,2	31,0	163,4	99,9
15-35	567,2	703,7	411,3	389,3	164,6	50,1	127,8
36-60	11,5	16,2	1,6	1,0	14,6	10,5	0,0
61-90	241,6	93,4	45,0	157,1	7,4	43,5	41,0
91-180	201,6	389,3	190,9	20,0	23,4	6,6	175,0
>180	118,4	206,3	154,9	60,0	1,4	0,0	58,4
<b>Total</b>	<b>1497,8</b>	<b>1781,7</b>	<b>1045,7</b>	<b>721,6</b>	<b>242,3</b>	<b>274,1</b>	<b>502,1</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.91%	5.66%	6.34%	5.79%
15-35	5.88%	5.95%	5.80%	5.89%
36-60	—	5.87%	5.70%	5.80%
61-90	5.81%	5.85%	5.64%	5.76%
91-180	5.89%	5.85%	5.48%	5.86%
>180	6.07%	6.14%	5.98%	6.07%
<b>Total</b>	<b>5.90%</b>	<b>5.87%</b>	<b>5.80%</b>	<b>5.86%</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>	65	138	2107	2269	32	146	8085	8844	124	213	4037	3744
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1189	1003	1	0	4941	3556	0	0	1858	1625
Otros <sup>c</sup>	138	65	572	579	146	32	976	1527	213	124	453	860
<b>Total</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>3868</b>	<b>3851</b>	<b>179</b>	<b>178</b>	<b>14002</b>	<b>13927</b>	<b>337</b>	<b>337</b>	<b>6348</b>	<b>6229</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.