

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de mayo de 2022
Fecha de Información: 29 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\$2210 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.76%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	201,3	290,0	221,7	101,6	13,3	44,8	55,0
15-35	730,4	693,8	254,7	372,1	132,1	51,4	306,9
36-60	24,7	32,7	25,0	16,2	7,7	8,4	0,0
61-90	122,8	165,5	30,0	0,0	30,5	17,8	105,0
91-180	144,4	264,9	186,0	75,5	13,2	3,3	65,6
>180	70,8	51,2	0,0	15,0	1,2	5,8	50,0
Total	1294,4	1497,9	717,5	580,5	197,9	131,4	582,6

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.15%		5.26%	4.70%	5.31%
15-35	6.30%		5.97%	5.05%	5.78%
36-60	—		6.22%	5.62%	6.10%
61-90	6.21%		5.51%	5.78%	6.02%
91-180	6.06%		5.53%	6.19%	5.78%
>180	6.12%		6.53%	5.64%	6.08%
Total	6.23%		5.73%	5.21%	5.76%

^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.

¹A 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.

²El 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	43	83	680	769	37	146	8251	9053	126	213	4114	3820
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	336	273	1	0	5133	3678	0	0	1928	1686
Otros ^c	83	43	310	279	146	37	976	1555	213	126	459	870
Total	126	126	1326	1321	184	183	14360	14286	339	339	6501	6376

^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.