

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de mayo de 2022
Fecha de Información: 02 de mayo 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\$4820 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.80%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	395,9	934,3	402,0	307,7	474,3	30,2	58,0
15-35	917,4	1402,4	1182,8	624,9	18,3	91,1	201,3
36-60	395,9	179,6	38,3	90,6	11,4	175,3	130,0
61-90	44,2	5,7	0,0	18,6	5,7	25,6	0,0
91-180	764,9	135,4	58,0	400,0	34,4	321,9	43,0
>180	51,7	44,4	25,0	23,1	0,4	9,6	19,0
Total	2569,9	2701,8	1706,0	1465,0	544,5	653,7	451,3

^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	5.91%	4.95%	6.06%	5.27%
15-35	6.12%	6.02%	6.17%	6.09%
36-60	6.14%	6.29%	6.13%	6.14%
61-90	—	6.17%	5.99%	6.02%
91-180	6.06%	6.16%	5.89%	5.93%
>180	6.18%	6.24%	6.02%	6.10%
Total	6.10%	5.47%	6.05%	5.80%

^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	02 – 06 may.				09 - 13 may.				16 - 20 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	41	147	8619	9649	129	214	4153	4082	52	189	5961	5175
Intragruppo y off-shore ^b	1	0	5428	3888	0	0	1953	1706	0	0	2865	2240
Otros ^c	147	41	1212	1647	214	129	696	889	189	52	527	1861
Total	189	188	15259	15184	343	343	6802	6677	241	241	9353	9276

^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.