

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de abril de 2022
Fecha de Información: 01 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\$2717 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.98%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	308,6	410,7	272,5	183,8	34,4	21,1	103,8
15-35	682,8	1170,4	769,4	229,3	25,0	77,6	376,0
36-60	2,5	7,4	0,0	0,9	7,4	1,6	0,0
61-90	163,1	91,2	30,5	113,7	13,6	2,4	47,0
91-180	15,3	38,8	0,0	5,0	29,3	0,8	9,5
>180	326,2	127,0	25,0	235,0	10,8	0,0	91,2
Total	1498,6	1845,5	1097,5	767,6	120,5	103,5	627,4

^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	4.93%		4.91%	4.35%	4.70%
15-35	4.91%		4.91%	4.80%	4.89%
36-60	-		5.21%	4.69%	5.08%
61-90	5.23%		5.35%	5.22%	5.25%
91-180	6.00%		6.04%	5.33%	6.02%
>180	6.14%		6.07%	6.13%	6.13%
Total	5.14%		5.01%	4.74%	4.98%

^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.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	28 mar. - 01 abr.				04 - 08 abr.				11 - 15 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	8	29	613	655	53	219	7036	7599	23	166	3894	4719
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	215	275	0	0	4925	3832	1	0	3175	2121
Otros ^c	29	8	143	36	219	53	798	1245	165	23	571	778
Total	37	37	971	966	272	272	12759	12676	189	189	7640	7618

^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.