

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de abril de 2022
Fecha de Información: 19 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\$2995 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.97%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	491,3	337,9	190,8	343,3	7,2	8,0	140,0
15-35	1107,6	1406,5	731,1	483,6	64,4	12,9	611,0
36-60	52,2	47,9	9,2	25,0	33,7	22,2	5,0
61-90	36,8	149,5	85,0	0,0	34,5	6,8	30,0
91-180	23,1	29,8	0,0	11,1	19,6	1,8	10,2
>180	52,2	56,6	50,0	50,0	6,6	2,2	0,0
Total	1763,1	2028,2	1066,0	913,0	165,9	53,9	796,3

^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	5.66%		5.12%	4.31%	4.86%
15-35	5.64%		4.37%	4.32%	4.84%
36-60	5.60%		5.61%	5.52%	5.58%
61-90	5.63%		5.74%	5.47%	5.68%
91-180	5.83%		6.72%	6.03%	6.30%
>180	-		6.10%	6.24%	6.17%
Total	5.64%		4.73%	4.53%	4.97%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	18 – 22 abr.				25 - 29 abr.				02 - 06 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	80	204	5817	5892	66	282	5758	5963	19	144	7177	7314
Intragrupo y off-shore ^b	10	0	3150	2883	0	0	3188	2988	1	0	4166	3225
Otros ^c	194	80	1092	1169	282	66	979	888	144	19	601	1335
Total	284	284	10059	9944	348	348	9925	9839	164	163	11944	11874

^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.