INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2022
Fecha de Información: 21 de abril de 2022[1]

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$2853 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.71%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	350,2	378,3	248,7	216,4	22,6	26,8	107,0
15-35	806,3	904,9	622,1	415,4	36,3	144,5	246,4
36-60	117,2	15,5	0,0	111,0	15,5	6,2	0,0
61-90	11,8	170,9	148,5	0,0	12,0	1,4	10,4
91-180	86,0	197,1	150,0	82,7	46,6	2,8	0,5
>180	113,7	143,4	56,3	35,0	9,1	0,7	78,0
Total	**1485,3**	**1810,2**	**1225,7**	**860,4**	**142,2**	**182,5**	**442,4**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.01%	7.91%	5.23%	5.87%
15-35	5.56%	5.60%	5.55%	5.58%
36-60	–	5.75%	5.41%	5.66%
61-90	5.64%	5.56%	5.36%	5.57%
91-180	6.07%	6.02%	5.68%	5.94%
>180	6.11%	6.23%	5.96%	6.11%
Total	**5.52%**	**6.03%**	**5.43%**	**5.71%**

[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: ((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

	18 – 22 abr.				25 - 29 abr.				02 - 06 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	24	98	3416	3508	72	283	5894	6389	20	145	7342	7767
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2053	1789	0	0	3381	3063	1	0	4489	3286
Otros[c]	98	24	386	466	283	72	1182	913	144	20	636	1344
Total	**122**	**122**	**5855**	**5763**	**355**	**355**	**10457**	**10365**	**165**	**165**	**12467**	**12397**

[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.