

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de mayo de 2022
Fecha de Información: 03 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\$3325 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.20%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	609,3	557,6	406,2	472,8	75,4	60,5	76,0
15-35	808,0	1358,9	914,5	313,3	45,8	96,2	398,6
36-60	95,6	82,6	62,9	2,0	9,3	83,2	10,4
61-90	8,1	3,5	0,8	0,0	2,7	8,1	0,0
91-180	140,8	74,3	40,0	106,7	4,3	4,1	30,0
>180	96,1	60,2	2,1	16,5	3,1	24,6	55,0
Total	1758,0	2137,1	1426,5	911,3	140,6	276,8	570,0

^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	6.27%	6.06%	5.96%	6.04%
15-35	6.29%	6.33%	6.18%	6.29%
36-60	6.14%	6.36%	6.08%	6.18%
61-90	—	6.36%	5.97%	6.07%
91-180	6.10%	6.09%	6.06%	6.07%
>180	6.20%	5.87%	6.16%	6.17%
Total	6.26%	6.28%	6.07%	6.20%

^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	28	116	7294	7929	131	214	4343	4507	53	189	6142	5366
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4821	3488	0	0	2206	1750	0	0	2905	2268
Otros ^c	115	28	1002	1640	214	131	772	938	189	53	531	1867
Total	144	144	13117	13057	345	345	7321	7195	242	242	9578	9501

^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.