

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de mayo de 2022
Fecha de Información: 04 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\$1904 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.24%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	458,0	366,1	101,0	183,5	33,1	42,5	232,0
15-35	326,9	922,2	754,2	107,5	26,0	77,4	142,0
36-60	23,2	8,5	2,0	9,0	6,5	14,2	0,0
61-90	12,6	4,9	0,0	0,0	4,9	12,6	0,0
91-180	92,1	106,8	15,6	37,0	41,9	5,7	49,3
>180	81,0	5,9	0,0	0,1	0,9	0,0	80,9
Total	993,8	1414,5	872,9	337,1	113,3	152,4	504,3

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.56%		6.49%	5.08%	5.97%
15-35	6.54%		6.41%	6.34%	6.42%
36-60	—		6.04%	6.11%	6.09%
61-90	—		6.02%	6.00%	6.01%
91-180	6.17%		6.23%	6.04%	6.17%
>180	6.24%		6.36%	6.17%	6.17%
Total	6.51%		6.41%	5.74%	6.24%

^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: ((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

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	22	99	5821	6108	141	214	4538	4742	53	190	6221	5484
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3662	2780	0	0	2301	1771	0	0	2925	2274
Otros ^c	99	22	762	1334	214	141	772	963	190	53	562	1872
Total	121	121	10245	10222	355	355	7611	7476	243	243	9708	9630

^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.