

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de mayo de 2022
Fecha de Información: 05 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\$1853 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.15%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	343,6	336,2	143,0	127,4	16,2	39,3	177,0
15-35	683,9	653,0	333,0	301,7	14,4	76,5	305,6
36-60	66,7	33,3	0,0	4,3	5,9	35,0	27,4
61-90	19,8	26,8	0,2	12,8	26,6	7,0	0,0
91-180	48,9	138,8	86,5	5,1	28,8	20,3	23,5
>180	92,6	17,7	5,0	18,1	2,7	0,0	74,5
Total	1255,5	1205,9	567,7	469,3	94,7	178,2	608,0

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.15%		5.07%	4.52%	5.43%
15-35	6.42%		6.52%	6.35%	6.43%
36-60	6.35%		6.81%	6.23%	6.32%
61-90	—		6.40%	6.07%	6.31%
91-180	6.14%		6.24%	5.93%	6.16%
>180	6.35%		6.28%	6.17%	6.20%
Total	6.31%		6.18%	5.96%	6.15%

^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	16	62	4436	4775	145	215	4726	4939	57	190	6285	5535
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2998	2198	0	0	2392	1836	0	0	2944	2284
Otros ^c	62	16	480	918	215	145	783	970	190	57	563	1896
Total	78	78	7914	7891	360	360	7901	7745	247	247	9792	9715

^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.