

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2022
Fecha de Información: 06 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\$1574 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.18%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	176,8	221,4	168,2	127,1	13,2	9,6	40,0
15-35	541,8	458,3	279,0	357,0	22,3	27,8	157,0
36-60	51,6	73,7	17,4	0,0	36,3	31,6	20,0
61-90	106,1	80,8	0,0	25,0	10,8	11,1	70,0
91-180	30,2	107,6	90,0	20,0	13,3	6,0	4,2
>180	7,8	11,6	2,3	2,1	7,3	3,7	2,0
Total	914,3	953,4	556,9	531,3	103,2	89,8	293,2

^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	6.29%		4.88%	5.87%	5.57%
15-35	6.27%		6.39%	6.25%	6.30%
36-60	6.27%		7.28%	6.08%	6.62%
61-90	6.21%		6.34%	6.30%	6.25%
91-180	6.39%		6.25%	5.57%	6.22%
>180	6.21%		6.40%	6.32%	6.35%
Total	6.26%		6.16%	6.13%	6.18%

^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	11	36	1154	1391	146	224	4845	5089	57	191	6347	5578
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	864	502	0	0	2509	1919	0	0	2971	2329
Otros ^c	36	11	51	176	224	146	786	975	191	57	564	1899
Total	47	47	2069	2069	370	370	8140	7983	248	248	9882	9806

^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.