

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2022
Fecha de Información: 09 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\$2441 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.07%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	228,1	721,8	462,8	73,4	206,1	101,7	53
15-35	794,4	691,0	327,3	437,9	64,7	57,6	299
36-60	45,0	39,9	28,0	10,0	1,9	25,0	10
61-90	105,4	11,3	4,8	0,0	6,5	105,4	0
91-180	2,3	16,6	0,0	0,0	16,6	2,3	0
>180	52,2	114,9	90,0	13,0	4,9	19,2	20
Total	1227,5	1595,5	912,8	534,3	300,6	311,2	382

^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	6.32%	6.02%	5.70%	5.95%
15-35	6.05%	6.10%	6.08%	6.08%
36-60	6.05%	6.17%	6.03%	6.09%
61-90	—	6.23%	6.07%	6.09%
91-180	—	6.18%	5.75%	6.12%
>180	6.47%	6.44%	6.34%	6.42%
Total	6.11%	6.11%	5.99%	6.07%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	09 – 13 may.				16 - 20 may.				23 - 27 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	149	227	5035	5405	58	255	6433	5929	52	336	6082	6528
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2689	1990	0	0	3273	2330	0	0	3889	2520
Otros ^c	227	149	892	1065	255	58	602	1972	336	52	615	1425
Total	376	376	8616	8460	313	313	10308	10231	388	388	10586	10473

^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.