

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2022
Fecha de Información: 10 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\$1962 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.88%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 | 471,8 | 442,3 | 118,6 | 150,8 | 25,7 | 23,0 | 298,0 |
| 15-35 | 592,9 | 724,2 | 438,5 | 286,2 | 27,0 | 48,0 | 258,8 |
| 36-60 | 190,3 | 189,2 | 10,0 | 10,5 | 13,4 | 14,1 | 165,8 |
| 61-90 | 4,0 | 7,7 | 0,0 | 0,0 | 7,7 | 4,0 | 0,0 |
| 91-180 | 5,5 | 36,9 | 0,0 | 0,0 | 35,2 | 3,8 | 1,7 |
| >180 | 7,6 | 13,2 | 10,1 | 0,0 | 3,1 | 7,6 | 0,0 |
| Total | 1272,2 | 1413,5 | 577,2 | 447,5 | 112,1 | 100,4 | 724,3 |

^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 | 6.07% | | 5.74% | 6.69% | 5.82% |
| 15-35 | 6.05% | | 5.70% | 5.79% | 5.83% |
| 36-60 | 6.08% | | 6.34% | 5.94% | 6.08% |
| 61-90 | — | | 6.25% | 6.03% | 6.18% |
| 91-180 | 6.52% | | 6.40% | 6.18% | 6.38% |
| >180 | — | | 6.53% | 6.31% | 6.45% |
| Total | 6.06% | | 5.80% | 5.65% | 5.88% |

^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 | 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 | 140 | 170 | 3748 | 3886 | 58 | 255 | 6573 | 6060 | 52 | 339 | 6170 | 6634 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 1594 | 1159 | 0 | 0 | 3331 | 2383 | 0 | 0 | 3921 | 2540 |
| Otros ^c | 170 | 140 | 755 | 918 | 255 | 58 | 610 | 1993 | 339 | 52 | 621 | 1426 |
| Total | 310 | 310 | 6097 | 5963 | 313 | 313 | 10514 | 10436 | 391 | 391 | 10712 | 10600 |

^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.