

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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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.