

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2022
Fecha de Información: 11 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\$2939 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.03%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	510,5	704,2	299,7	255,5	268,8	119,3	135,7
15-35	725,1	777,6	376,0	382,4	125,4	66,4	276,2
36-60	5,0	12,8	1,6	0,0	11,2	5,0	0,0
61-90	29,9	79,8	40,0	0,0	22,1	12,2	17,7
91-180	87,8	97,4	30,0	48,0	37,4	9,8	30,0
>180	238,0	140,6	100,0	0,0	30,6	228,0	10,0
Total	1596,3	1812,4	847,3	685,9	495,6	440,7	469,6

^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	6.16%	5.46%	5.75%	5.68%
15-35	6.16%	6.20%	5.93%	6.12%
36-60	—	7.18%	5.71%	6.72%
61-90	6.09%	6.18%	5.94%	6.12%
91-180	6.30%	6.34%	6.26%	6.31%
>180	6.42%	6.56%	6.40%	6.45%
Total	6.17%	5.96%	6.02%	6.03%

^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	132	132	2992	3088	61	256	6902	6667	53	339	6196	6653
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1172	794	0	0	3556	2588	0	0	3921	2540
Otros ^c	132	132	615	780	256	61	876	2002	339	53	628	1439
Total	264	264	4779	4662	317	317	11334	11257	392	392	10745	10632

^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.