

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2022
Fecha de Información: 12 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\$2418 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.11%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	297,4	492,4	310,6	182,8	88,7	21,4	93,2
15-35	767,0	687,9	412,7	337,3	22,2	176,6	253,0
36-60	54,2	11,5	0,0	19,5	5,8	28,9	5,7
61-90	100,5	59,9	25,0	60,0	4,9	10,5	30,0
91-180	83,1	148,1	60,0	10,0	28,1	13,1	60,0
>180	126,3	106,5	30,0	10,9	1,5	40,4	75,0
Total	1428,5	1506,3	838,3	620,6	151,1	291,0	516,9

^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	6.10%		5.78%	5.95%	5.89%
15-35	6.17%		6.26%	6.08%	6.16%
36-60	5.95%		6.16%	5.91%	5.95%
61-90	6.12%		6.10%	5.90%	6.05%
91-180	6.15%		6.31%	5.90%	6.16%
>180	6.67%		6.48%	6.19%	6.50%
Total	6.22%		6.08%	6.04%	6.11%

^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	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	49	92	1951	2022	64	256	7192	7007	54	339	6276	6841
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	736	477	0	0	3667	2725	0	0	4045	2541
Otros ^c	92	49	376	549	256	64	961	2011	339	54	633	1446
Total	141	141	3063	3048	320	320	11820	11743	393	393	10954	10828

^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.