

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2022
Fecha de Información: 17 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\$4216 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.31%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 | 670,7 | 1256,6 | 379,1 | 487,8 | 710,6 | 15,9 | 167,0 |
| 15-35 | 684,7 | 837,4 | 571,1 | 453,1 | 52,8 | 18,1 | 213,5 |
| 36-60 | 297,2 | 98,8 | 45,1 | 53,6 | 38,7 | 228,6 | 15,0 |
| 61-90 | 514,0 | 11,9 | 0,0 | 0,0 | 11,9 | 514,0 | 0,0 |
| 91-180 | 96,9 | 111,3 | 34,1 | 22,0 | 17,2 | 14,9 | 60,0 |
| >180 | 63,8 | 62,9 | 20,0 | 20,0 | 7,9 | 8,8 | 35,0 |
| Total | 2327,3 | 2379,0 | 1049,3 | 1036,5 | 839,1 | 800,3 | 490,6 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 6.20% | | 3.31% | 5.09% | 4.09% |
| 15-35 | 6.21% | | 6.12% | 6.21% | 6.16% |
| 36-60 | 6.03% | | 6.33% | 6.14% | 6.16% |
| 61-90 | — | | 6.40% | 5.80% | 5.81% |
| 91-180 | 6.34% | | 6.58% | 6.25% | 6.39% |
| >180 | 6.88% | | 6.69% | 6.15% | 6.67% |
| Total | 6.27% | | 4.47% | 5.81% | 5.31% |

^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 | 16 – 20 may. | | | | 23 - 27 may. | | | | 30 may. - 03 jun. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 31 | 221 | 5666 | 6486 | 56 | 349 | 6730 | 7654 | 21 | 127 | 5048 | 5648 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2984 | 1920 | 0 | 0 | 4356 | 2911 | 0 | 0 | 3342 | 2143 |
| Otros ^c | 221 | 31 | 1524 | 1714 | 349 | 56 | 1089 | 1482 | 127 | 21 | 631 | 1171 |
| Total | 252 | 252 | 10174 | 10120 | 405 | 405 | 12175 | 12047 | 148 | 148 | 9021 | 8962 |

^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.