

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