

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2022
Fecha de Información: 18 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\$3170 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.94%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	624,1	469,9	129,2	431,0	213,8	66,0	127,0
15-35	574,6	1037,4	775,4	271,6	14,9	56,0	247,1
36-60	245,3	46,7	0,0	60,0	36,7	175,3	10,0
61-90	127,2	212,8	100,0	25,0	12,8	2,2	100,0
91-180	96,9	93,7	30,0	0,0	8,7	41,9	55,0
>180	102,9	137,3	75,0	40,0	2,3	2,9	60,0
Total	1771,1	1997,7	1109,6	827,6	289,1	344,3	599,1

^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	6.12%	5.20%	5.24%	5.39%
15-35	6.17%	6.17%	6.07%	6.15%
36-60	6.22%	6.03%	6.06%	6.07%
61-90	6.01%	6.31%	6.08%	6.05%
91-180	6.19%	6.29%	5.81%	6.10%
>180	6.79%	6.58%	6.78%	6.71%
Total	6.20%	5.93%	5.75%	5.94%

^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	56	194	4977	5571	57	351	6915	8036	21	128	5086	5687
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2395	1637	0	0	4458	3013	0	0	3346	2151
Otros ^c	194	56	1453	1572	350	57	1296	1491	128	21	637	1171
Total	250	250	8825	8780	407	408	12669	12540	149	149	9069	9009

^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.