

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2022
Fecha de Información: 19 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\$3172 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.80%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	376,6	815,1	164,5	229,0	525,6	22,6	125
15-35	674,7	731,6	382,5	328,5	41,0	38,2	308
36-60	148,8	35,9	0,0	32,5	35,9	116,3	0
61-90	17,1	72,6	40,0	0,0	17,6	2,1	15
91-180	585,1	152,5	45,0	80,0	27,5	425,1	80
>180	78,6	21,3	3,0	60,0	8,3	8,6	10
Total	1880,9	1828,9	635,0	730,0	655,8	612,9	538

^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%	4.62%	6.07%	5.15%
15-35	6.13%	6.69%	5.97%	6.25%
36-60	—	6.09%	6.15%	6.13%
61-90	5.95%	6.10%	6.15%	6.07%
91-180	6.25%	6.42%	6.04%	6.10%
>180	6.48%	6.69%	6.85%	6.77%
Total	6.16%	5.33%	6.08%	5.80%

^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	43	144	3806	4095	58	403	7170	8634	21	131	5421	6092
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1968	1200	0	0	4551	3212	0	0	3557	2291
Otros ^c	144	43	1157	1589	402	58	1765	1511	131	21	641	1173
Total	187	187	6931	6884	460	461	13486	13357	152	152	9619	9556

^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.