

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2022
Fecha de Información: 20 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\$2608 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.52%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	618,2	473,6	281,1	442,7	113,0	96,0	79,5
15-35	450,7	819,8	528,7	309,5	163,1	13,2	128,0
36-60	22,2	134,0	5,0	0,0	128,5	21,7	0,5
61-90	18,6	62,7	0,0	16,0	62,7	2,6	0,0
91-180	89,6	77,1	0,0	25,0	72,1	59,6	5,0
>180	24,0	45,3	0,0	0,0	30,3	9,0	15,0
Total	1223,4	1612,5	814,8	793,2	569,6	202,1	228,0

^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	6.01%	3.84%	5.15%	4.77%
15-35	5.97%	6.01%	5.77%	5.93%
36-60	6.11%	6.19%	5.86%	6.14%
61-90	—	6.17%	5.80%	6.15%
91-180	6.30%	6.41%	6.13%	6.26%
>180	6.69%	6.67%	6.38%	6.63%
Total	6.04%	5.46%	5.45%	5.52%

^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	9	112	1305	1750	84	419	7604	8883	40	136	5486	6209
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	748	242	1	0	4646	3526	0	0	3600	2291
Otros ^c	112	9	696	757	418	84	1850	1562	136	40	649	1173
Total	121	121	2749	2749	503	503	14100	13971	176	176	9735	9673

^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.