

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2022
Fecha de Información: 23 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\$3246 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.40%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	445,0	788,6	107,5	338,5	584,2	9,7	96,9
15-35	587,5	663,2	384,3	387,8	135,1	55,8	143,9
36-60	198,0	66,8	15,0	26,5	36,8	156,5	15,0
61-90	176,9	24,4	0,0	15,0	24,4	161,9	0,0
91-180	394,7	157,8	55,0	17,0	67,8	342,7	35,0
>180	11,0	23,3	10,0	10,0	13,3	1,0	0,0
Total	1813,1	1724,1	571,9	794,8	861,5	727,6	290,7

^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	5.78%		4.86%	5.76%	5.14%
15-35	5.72%		4.62%	5.73%	5.18%
36-60	5.78%		6.09%	5.75%	5.80%
61-90	—		6.12%	5.30%	5.41%
91-180	6.00%		6.29%	5.85%	5.96%
>180	—		6.77%	6.24%	6.73%
Total	5.77%		5.00%	5.71%	5.40%

^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.

¹A 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.

²El 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	23 – 27 may.				30 may. - 03 jun.				06 - 10 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	85	426	8069	9100	41	139	5531	6798	57	194	4321	3818
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4714	3942	0	0	3626	2330	0	0	2086	2122
Otros ^c	426	85	1952	1565	139	41	1212	1179	194	57	493	676
Total	512	511	14735	14607	180	180	10369	10307	251	251	6900	6616

^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.