

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2022
Fecha de Información: 24 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\$3425 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.04%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	761,7	432,7	138,3	706,1	246,4	7,6	48,0
15-35	497,5	987,6	500,9	199,3	215,5	26,9	271,3
36-60	160,0	51,0	0,0	4,6	11,0	115,5	40,0
61-90	3,3	297,9	273,2	0,0	24,7	3,3	0,0
91-180	456,1	117,4	0,0	50,0	57,4	346,1	60,0
>180	54,6	78,4	0,0	0,0	24,4	0,6	54,0
Total	1933,2	1965,1	912,4	959,9	579,4	500,0	473,3

^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	5.74%	3.69%	5.64%	4.53%
15-35	5.74%	3.96%	4.83%	4.66%
36-60	5.79%	5.83%	5.62%	5.67%
61-90	—	6.05%	5.73%	6.01%
91-180	6.16%	6.20%	5.55%	5.69%
>180	6.85%	6.79%	6.17%	6.83%
Total	5.92%	4.16%	5.45%	5.04%

^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	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	83	384	7063	7588	41	139	5840	7100	63	195	4365	4199
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3826	3340	0	0	3668	2611	0	0	2234	2135
Otros ^c	383	83	1687	1532	139	41	1450	1183	195	63	695	677
Total	466	467	12576	12460	180	180	10958	10894	258	258	7294	7011

^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.