

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2022
Fecha de Información: 25 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\$3467 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.92%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	687,8	406,2	168,3	505,0	75,3	20,3	162,6
15-35	943,8	1202,8	656,3	428,6	70,3	38,9	476,3
36-60	108,9	77,1	4,0	1,6	40,1	74,4	33,0
61-90	30,7	103,6	48,9	0,0	24,7	0,7	30,0
91-180	299,5	235,6	25,0	133,6	45,6	0,9	165,0
>180	157,0	146,2	72,6	90,7	8,6	1,3	65,0
Total	2227,7	2171,5	975,0	1159,4	264,7	136,5	931,8

^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	5.90%	5.51%	5.63%	5.66%
15-35	5.89%	6.07%	5.83%	5.94%
36-60	5.88%	6.37%	5.66%	5.91%
61-90	5.85%	6.06%	5.78%	5.94%
91-180	6.15%	6.25%	6.19%	6.18%
>180	6.80%	6.87%	6.79%	6.80%
Total	6.00%	5.98%	5.78%	5.92%

^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	77	202	5897	6066	42	143	6252	7401	63	199	4490	4361
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3134	2998	0	0	3838	2925	0	0	2335	2201
Otros ^c	202	77	1181	1047	143	42	1509	1200	198	63	697	677
Total	279	279	10212	10111	185	185	11599	11526	261	262	7522	7239

^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.