

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2022
Fecha de Información: 26 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\$4000 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	776,6	259,2	144,8	668,4	27,4	21,2	87,0
15-35	1104,5	1318,6	894,0	774,7	150,5	55,6	274,1
36-60	58,3	52,3	20,0	30,1	22,9	18,8	9,3
61-90	19,7	150,7	110,0	2,0	30,7	7,7	10,0
91-180	297,6	252,5	96,3	180,0	61,2	22,6	95,0
>180	130,6	184,5	40,0	0,1	14,5	0,6	130,0
Total	2387,2	2217,8	1305,2	1655,3	307,2	126,5	605,4

^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	5.86%	5.76%	4.57%	4.88%
15-35	5.85%	5.47%	5.74%	5.61%
36-60	5.82%	5.78%	5.83%	5.81%
61-90	5.75%	6.05%	5.81%	5.97%
91-180	6.02%	6.28%	5.53%	5.90%
>180	6.67%	6.74%	6.47%	6.69%
Total	6.05%	5.63%	5.15%	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	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	56	145	4123	4107	44	144	6807	7609	67	201	4690	4497
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2047	1934	0	0	3951	3379	0	0	2407	2338
Otros ^c	145	56	642	670	144	44	1517	1213	200	67	706	685
Total	201	201	6812	6711	188	188	12275	12201	267	268	7803	7520

^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.