

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de junio de 2022
Fecha de Información: 27 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\$2558 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.38%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	432,5	137,7	49,9	251,8	47,8	140,8	40,0
15-35	789,9	762,0	317,8	511,7	253,1	87,2	191,0
36-60	6,8	175,6	134,0	0,0	40,1	5,3	1,5
61-90	64,7	99,4	10,0	0,0	54,4	29,7	35,0
91-180	69,0	178,9	65,0	30,0	113,9	39,0	0,0
>180	63,0	91,6	30,0	15,0	15,8	2,2	45,8
Total	1425,9	1445,1	606,8	808,5	525,0	304,1	313,3

^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	5.68%	6.66%	4.02%	4.50%
15-35	5.64%	5.64%	5.35%	5.52%
36-60	5.65%	5.15%	5.54%	5.17%
61-90	5.70%	5.96%	5.64%	5.82%
91-180	—	5.90%	6.04%	5.94%
>180	6.72%	6.68%	6.67%	6.70%
Total	5.81%	5.71%	4.89%	5.38%

^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	42	83	627	623	51	146	7072	7671	78	220	4745	4521
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	196	228	0	0	3988	3514	0	0	2415	2386
Otros ^c	83	42	231	191	146	51	1528	1330	219	78	723	692
Total	125	125	1054	1042	197	197	12588	12515	297	298	7883	7599

^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.