INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2022
Fecha de Información: 13 de mayo de 2022[1]

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$2497 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.87%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	305,5	617,9	247,1	120,9	209,6	23,4	161,2
15-35	741,0	693,5	396,4	400,7	20,6	63,8	276,5
36-60	310,8	61,8	20,0	20,0	21,8	270,8	20,0
61-90	87,3	32,9	10,0	75,0	22,9	12,3	0,0
91-180	3,2	91,1	70,6	0,0	20,5	3,2	0,0
>180	1,2	8,1	0,0	0,0	8,1	1,2	0,0
Total	**1449,0**	**1505,4**	**744,1**	**616,6**	**303,6**	**374,7**	**457,7**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.37%	4.26%	6.18%	5.12%
15-35	6.35%	6.40%	6.17%	6.30%
36-60	6.11%	6.51%	5.88%	5.94%
61-90	–	6.32%	6.05%	6.18%
91-180	–	6.49%	6.16%	6.46%
>180	–	6.64%	4.18%	6.33%
Total	**6.35%**	**5.36%**	**6.05%**	**5.87%**

[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: ((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

	09 – 13 may.				16 - 20 may.				23 - 27 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	40	58	982	1069	68	256	7334	7422	54	345	6303	6917
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	347	153	0	0	3852	2819	0	0	4117	2566
Otros[c]	58	40	229	333	256	68	1161	2029	345	54	636	1447
Total	**98**	**98**	**1558**	**1555**	**324**	**324**	**12347**	**12270**	**399**	**399**	**11056**	**10930**

[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.