

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de junio de 2022
Fecha de Información: 31 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\$3862 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.07%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	708,5	601,5	386,3	510,3	33,2	16,2	182,0
15-35	797,8	949,5	630,1	506,0	112,6	84,9	206,8
36-60	294,2	79,6	0,0	274,9	71,3	11,0	8,3
61-90	1,7	62,6	0,0	0,0	62,6	1,7	0,0
91-180	224,3	202,2	49,0	216,0	153,2	8,3	0,0
>180	243,9	211,4	33,0	122,0	60,4	3,9	118,0
Total	2270,4	2106,8	1098,4	1629,3	493,3	125,9	515,1

^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	4.76%	4.56%	Inf%	4.55%
15-35	4.83%	4.97%	4.37%	4.71%
36-60	5.17%	5.78%	4.90%	5.62%
61-90	—	5.95%	5.08%	5.93%
91-180	—	6.22%	5.92%	6.16%
>180	6.73%	6.84%	6.54%	6.69%
Total	5.25%	5.35%	4.68%	5.07%

^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	30 may. - 03 jun.				06 - 10 jun.				13 - 17 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	55	147	7621	7911	81	228	4864	4809	50	198	7491	7801
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4091	3932	0	0	2682	2485	1	0	4740	3589
Otros ^c	147	55	1535	1331	227	81	730	699	197	50	1186	1897
Total	202	202	13247	13174	308	309	8276	7993	248	248	13417	13287

^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.