

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de junio de 2022
Fecha de Información: 02 de junio 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\$3036 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.36%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|-------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 463,4 | 641,1 | 444,9 | 277,5 | 32,2 | 21,9 | 164,0 |
| 15-35 | 644,8 | 726,8 | 353,1 | 375,7 | 129,2 | 24,6 | 244,5 |
| 36-60 | 5,5 | 29,8 | 0,0 | 0,0 | 25,0 | 0,7 | 4,8 |
| 61-90 | 124,2 | 106,1 | 40,0 | 53,7 | 21,1 | 25,5 | 45,0 |
| 91-180 | 431,9 | 528,3 | 195,0 | 181,6 | 88,3 | 5,3 | 245,0 |
| >180 | 24,0 | 13,0 | 0,8 | 16,7 | 12,3 | 7,3 | 0,0 |
| Total | 1693,7 | 2045,2 | 1033,7 | 905,1 | 308,2 | 85,3 | 703,3 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 5.12% | | 5.35% | 5.19% | 5.24% |
| 15-35 | 5.24% | | 4.97% | 4.48% | 4.97% |
| 36-60 | 5.19% | | 8.70% | 4.99% | 8.06% |
| 61-90 | 5.61% | | 5.92% | 5.17% | 5.42% |
| 91-180 | 5.98% | | 6.17% | 5.88% | 6.04% |
| >180 | — | | 6.62% | 6.17% | 6.46% |
| Total | 5.49% | | 5.43% | 5.00% | 5.36% |

^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.

¹A 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.

²El 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

| 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 | 21 | 71 | 4692 | 4710 | 89 | 231 | 5053 | 5388 | 51 | 216 | 8261 | 8808 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2822 | 2709 | 0 | 0 | 3104 | 2621 | 1 | 0 | 5219 | 3845 |
| Otros ^c | 71 | 21 | 440 | 498 | 231 | 89 | 842 | 707 | 215 | 51 | 1223 | 1918 |
| Total | 92 | 92 | 7954 | 7917 | 320 | 320 | 8999 | 8716 | 267 | 267 | 14703 | 14571 |

^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.