

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		Intragruppo 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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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.

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	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.