

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de junio de 2022
Fecha de Información: 03 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\$4218 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.63%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	749,5	1000,8	314,8	288,0	366,0	141,5	320
15-35	721,4	552,7	91,8	303,9	50,9	7,6	410
36-60	10,8	30,8	0,5	0,0	20,3	0,8	10
61-90	600,9	58,2	10,0	600,0	48,2	0,9	0
91-180	417,2	853,8	601,0	1,0	177,8	341,2	75
>180	19,1	24,9	0,3	12,0	17,7	0,1	7
Total	2518,9	2521,1	1018,3	1204,8	680,8	492,0	822

^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	5.47%		2.61%	3.42%	3.51%
15-35	5.54%		5.72%	5.45%	5.53%
36-60	5.78%		5.68%	7.36%	5.75%
61-90	—		5.95%	5.60%	5.94%
91-180	6.07%		5.81%	5.53%	5.68%
>180	6.70%		6.73%	6.42%	6.63%
Total	5.57%		3.74%	4.74%	4.63%

^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	8	39	957	1032	91	236	5414	5776	51	228	8693	9461
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	517	384	0	0	3260	2756	1	0	5447	4055
Otros ^c	39	8	157	211	235	91	851	710	227	51	1568	2056
Total	47	47	1631	1627	326	327	9525	9242	279	279	15708	15572

^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.