

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de junio de 2022
Fecha de Información: 07 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\$4744 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.83%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	663,7	679,8	410,1	444,3	53,7	3,4	216,0
15-35	709,0	852,8	549,2	465,4	117,8	57,8	185,8
36-60	146,5	884,6	825,0	120,2	41,2	7,9	18,4
61-90	600,3	57,3	44,2	600,0	13,1	0,3	0,0
91-180	307,6	231,2	103,9	250,0	72,3	2,6	55,0
>180	68,4	53,9	7,1	21,8	10,8	10,6	36,0
Total	2495,5	2759,7	1939,5	1901,6	308,9	82,6	511,2

^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	6.23%	5.78%	5.74%	5.89%
15-35	6.07%	5.24%	6.04%	5.64%
36-60	6.08%	6.19%	6.07%	6.10%
61-90	—	6.32%	5.72%	6.31%
91-180	6.39%	6.29%	5.34%	5.81%
>180	6.74%	6.74%	6.57%	6.69%
Total	6.22%	5.60%	5.83%	5.83%

^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	06 – 10 jun.				13 - 17 jun.				20 - 24 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	84	204	5834	5905	52	224	9379	10518	30	201	4376	4740
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3471	3146	1	0	5844	4518	0	0	2503	1852
Otros ^c	204	84	756	726	223	52	2041	2058	201	30	667	872
Total	288	288	10061	9777	276	276	17264	17094	231	231	7546	7464

^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.