

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2022
Fecha de Información: 09 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\$3046 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.91%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	472,4	466,6	288,4	354,5	112,2	0,0	117,9
15-35	794,6	1098,1	617,2	342,8	0,0	47,8	403,9
36-60	108,9	19,6	0,0	0,4	13,6	102,5	6,0
61-90	42,1	45,0	25,0	30,0	10,0	2,1	10,0
91-180	199,4	263,0	214,0	163,7	17,0	3,8	32,0
>180	99,9	9,1	0,0	65,0	6,1	31,9	3,0
Total	1717,3	1901,3	1144,7	956,3	158,9	188,1	572,9

^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	6.08%	6.34%	4.97%	5.76%
15-35	6.18%	5.81%	5.56%	5.91%
36-60	6.10%	6.32%	6.07%	6.10%
61-90	6.06%	6.33%	5.04%	5.48%
91-180	6.38%	6.89%	6.32%	6.51%
>180	6.71%	7.24%	6.63%	6.69%
Total	6.18%	6.10%	5.50%	5.91%

^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	44	121	3208	3305	54	227	10047	11139	31	203	4470	4885
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2155	2088	1	0	6124	5019	0	0	2592	1872
Otros ^c	121	44	362	273	226	54	2246	2074	202	31	672	885
Total	165	165	5725	5666	281	281	18417	18232	233	234	7734	7642

^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.