

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de junio de 2022
Fecha de Información: 10 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\$2841 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.75%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	396,7	257,0	176,2	236,9	13,6	92,5	67,3
15-35	952,4	980,4	543,9	516,9	93,8	92,7	342,8
36-60	25,8	17,7	0,0	0,0	17,7	25,8	0,0
61-90	53,7	58,7	0,0	0,0	13,7	8,7	45,0
91-180	97,3	429,8	375,0	45,2	18,5	15,8	36,4
>180	51,7	26,9	10,0	10,0	0,9	25,8	15,9
Total	1577,7	1770,5	1105,0	809,0	158,2	261,4	507,4

^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	6.36%	6.31%	3.34%	4.47%
15-35	6.20%	6.12%	6.16%	6.16%
36-60	—	6.76%	6.06%	6.35%
61-90	6.21%	6.34%	6.01%	6.21%
91-180	6.39%	6.62%	6.29%	6.39%
>180	6.69%	7.00%	6.66%	6.67%
Total	6.25%	6.19%	4.87%	5.75%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ {(365/\text{Plazo}))} - 1$. 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	41	64	887	966	57	228	10389	11302	35	203	4503	4973
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	637	606	1	0	6222	5238	0	0	2676	1876
Otros ^c	64	41	185	131	227	57	2257	2144	203	35	674	900
Total	105	105	1709	1703	285	285	18868	18684	238	238	7853	7749

^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.