

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2022
Fecha de Información: 14 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\$2394 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.00%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	428,3	414,5	292,9	327,7	62,4	41,3	59,3
15-35	687,5	675,0	350,4	353,8	63,4	72,4	261,3
36-60	77,4	99,3	45,0	0,0	39,3	62,4	15,0
61-90	3,6	15,1	0,0	0,0	15,1	3,6	0,0
91-180	123,1	169,8	97,6	16,1	17,2	51,9	55,0
>180	29,5	64,5	57,5	20,2	4,0	6,3	3,0
Total	1349,3	1438,3	843,4	717,9	201,3	237,9	393,5

^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	5.31%	6.05%	5.81%	5.83%
15-35	6.02%	6.06%	5.98%	6.03%
36-60	7.30%	6.26%	5.93%	6.22%
61-90	—	6.36%	5.96%	6.28%
91-180	6.06%	6.31%	6.07%	6.11%
>180	6.67%	6.67%	6.54%	6.59%
Total	5.97%	6.10%	5.91%	6.00%

^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	13 – 17 jun.				20 - 24 jun.				27 jun. - 01 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	56	199	5915	6835	37	205	4793	5361	44	196	6301	6316
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4066	3271	0	0	2983	1968	3	0	3572	3387
Otros ^c	198	56	846	627	205	37	743	1082	193	44	961	942
Total	255	255	10827	10733	242	242	8519	8411	240	240	10834	10645

^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.