

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2022
Fecha de Información: 15 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\$3683 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.52%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	857,6	676,3	293,5	691,5	257,8	41,0	125,0
15-35	532,8	1159,5	971,8	255,7	47,3	136,8	140,4
36-60	34,3	58,0	32,9	32,4	25,1	1,9	0,0
61-90	5,2	26,7	0,0	0,0	26,7	5,2	0,0
91-180	417,0	139,1	46,3	163,2	53,8	214,7	39,0
>180	37,5	60,7	31,5	18,6	12,2	1,9	17,0
Total	1884,4	2120,4	1376,0	1161,4	423,0	401,7	321,4

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.25%		2.71%	6.19%	4.83%
15-35	4.83%		6.12%	5.94%	5.89%
36-60	—		6.45%	5.81%	6.41%
61-90	—		6.32%	5.79%	6.23%
91-180	6.18%		6.40%	5.87%	5.98%
>180	6.72%		6.72%	6.56%	6.67%
Total	5.64%		5.02%	6.04%	5.52%

^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	50	177	5454	5935	37	215	5030	5721	59	200	6394	6466
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	3550	3150	0	0	3112	2162	3	0	3637	3419
Otros ^c	176	50	590	453	214	37	953	1103	197	59	1008	945
Total	227	227	9594	9538	251	252	9095	8986	259	259	11039	10830

^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.