

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2022
Fecha de Información: 16 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\$3143 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.51%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	596,6	662,2	384,1	475,1	183,1	26,5	95,0
15-35	582,9	871,3	655,5	363,9	25,3	28,5	190,5
36-60	226,9	48,6	29,5	80,0	19,1	146,9	0,0
61-90	4,2	19,3	2,0	0,0	16,5	3,5	0,8
91-180	122,3	111,2	64,9	81,6	31,2	25,7	15,0
>180	188,9	175,1	0,0	23,0	10,1	0,9	165,0
Total	1721,9	1887,6	1136,0	1023,6	285,3	232,0	466,3

^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	4.73%	5.64%	4.41%	5.02%
15-35	5.67%	5.71%	5.23%	5.59%
36-60	—	6.12%	5.93%	5.98%
61-90	6.10%	6.26%	4.63%	5.98%
91-180	6.08%	6.36%	6.04%	6.19%
>180	6.55%	7.14%	6.52%	6.58%
Total	5.80%	5.75%	5.02%	5.51%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	40	110	4085	4324	40	215	5330	6110	60	200	6502	6711
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2777	2500	0	0	3310	2408	3	0	3848	3503
Otros ^c	110	40	352	354	214	40	1100	1114	197	60	1042	949
Total	150	150	7214	7178	254	255	9740	9632	260	260	11392	11163

^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.