

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2022
Fecha de Información: 17 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\$2427 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.82%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	405,7	446,9	189,4	203,2	87,0	32,0	170,5
15-35	708,0	623,5	335,2	314,9	69,8	174,7	218,5
36-60	41,4	47,7	3,6	28,6	44,1	12,8	0,0
61-90	8,9	35,8	22,0	0,0	13,8	8,9	0,0
91-180	112,2	193,8	98,4	27,3	52,1	41,6	43,3
>180	183,8	129,1	25,0	20,0	26,1	85,8	78,0
Total	1460,0	1476,9	673,5	594,0	293,0	355,6	510,3

^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	5.92%	5.96%	3.89%	5.44%
15-35	5.88%	5.78%	5.82%	5.82%
36-60	—	6.10%	5.72%	6.02%
61-90	—	6.09%	5.79%	5.98%
91-180	5.99%	6.25%	5.99%	6.10%
>180	6.56%	6.66%	6.42%	6.51%
Total	6.01%	5.97%	5.52%	5.82%

^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	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	10	57	1093	1137	48	222	5457	6280	61	203	6702	6982
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	587	604	0	0	3382	2500	3	0	3956	3512
Otros ^c	57	10	206	126	221	48	1171	1122	200	61	1049	965
Total	67	67	1886	1867	269	270	10010	9902	264	264	11707	11459

^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.