

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de junio de 2022
Fecha de Información: 22 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\$2724 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.68%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	604,7	730,1	371,4	349,6	134,7	31,1	224
15-35	483,4	780,9	498,6	196,5	82,3	87,0	200
36-60	144,6	81,0	0,0	0,0	81,0	144,6	0
61-90	145,1	66,7	31,6	121,2	15,1	3,9	20
91-180	54,4	42,0	0,0	30,3	22,0	4,1	20
>180	10,1	54,9	40,0	0,0	4,9	0,1	10
Total	1442,4	1755,6	941,6	697,6	340,1	270,8	474

^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	5.89%	5.24%	5.06%	5.36%
15-35	5.61%	5.96%	5.76%	5.82%
36-60	—	5.96%	5.85%	5.89%
61-90	5.84%	5.90%	5.83%	5.85%
91-180	5.98%	6.49%	5.99%	6.14%
>180	6.44%	6.71%	6.25%	6.65%
Total	5.79%	5.71%	5.56%	5.68%

^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	20 – 24 jun.				27 jun. - 01 jul.				04 - 08 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	38	160	4544	5056	68	202	6967	7567	13	140	4840	4664
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	2679	2420	2	0	4300	3611	0	0	2506	2535
Otros ^c	159	38	921	591	199	68	1185	1020	140	13	559	628
Total	199	198	8144	8067	269	270	12452	12198	153	153	7905	7827

^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.