

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2022
Fecha de Información: 24 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\$1886 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.83%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	276,5	324,9	263,8	211,4	20,0	24,0	41,1
15-35	533,7	662,7	548,1	290,8	14,5	142,8	100,1
36-60	23,5	20,9	0,0	0,2	20,9	23,3	0,0
61-90	17,8	26,5	15,7	5,0	5,8	7,8	5,0
91-180	30,4	35,2	11,6	0,0	9,8	16,6	13,8
>180	49,3	50,5	39,3	38,4	4,9	4,7	6,2
Total	931,2	1120,8	878,6	545,8	75,9	219,1	166,3

^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	6.06%	6.12%	4.28%	5.29%
15-35	6.06%	6.06%	5.94%	6.01%
36-60	—	6.15%	5.75%	5.93%
61-90	5.97%	6.34%	5.68%	5.99%
91-180	6.25%	6.37%	5.91%	6.18%
>180	6.40%	6.41%	6.59%	6.50%
Total	6.09%	6.12%	5.46%	5.83%

^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	14	62	475	726	82	211	7339	8142	18	144	4926	4764
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	465	123	2	0	4786	3880	0	0	2565	2550
Otros ^c	62	14	98	181	209	82	1201	1045	144	18	574	672
Total	76	76	1038	1030	293	293	13326	13067	162	162	8065	7986

^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.