

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de junio de 2022
Fecha de Información: 28 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\$2905 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	562,8	675,5	410,7	284,0	125,7	139,8	139,0
15-35	745,8	789,7	442,7	494,5	160,0	64,3	187,0
36-60	156,1	54,5	5,4	0,0	49,1	156,1	0,0
61-90	85,2	28,3	14,8	49,0	13,6	36,2	0,0
91-180	7,4	23,5	1,9	0,0	21,6	7,4	0,0
>180	45,2	102,1	56,5	0,0	4,6	0,0	45,2
Total	1602,5	1673,6	932,0	827,5	374,6	403,8	371,2

^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	6.01%		6.02%	4.78%	5.40%
15-35	6.02%		6.05%	5.79%	5.97%
36-60	—		6.15%	6.00%	6.03%
61-90	—		6.27%	6.11%	6.13%
91-180	—		6.47%	6.10%	6.37%
>180	6.79%		6.59%	6.44%	6.67%
Total	6.10%		6.09%	5.46%	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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	27 jun. - 01 jul.				04 - 08 jul.				11 - 15 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	83	214	7963	8898	23	143	5072	4864	35	220	6141	5602
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	5182	4187	0	0	2565	2594	0	0	3333	2873
Otros ^c	211	83	1432	1232	143	23	575	674	219	35	846	1731
Total	296	297	14577	14317	166	166	8212	8132	254	255	10320	10206

^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.