

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de junio de 2022
Fecha de Información: 29 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\$5767 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.81%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	737,1	727,5	117,2	500,8	429,1	55,1	181,2
15-35	973,3	1464,0	1159,9	611,3	73,3	131,2	230,8
36-60	145,7	25,5	0,0	0,0	25,5	145,7	0,0
61-90	683,2	155,1	70,0	215,4	24,9	407,6	60,2
91-180	505,6	822,8	661,8	332,0	16,0	28,6	145,0
>180	88,9	144,2	27,0	0,0	31,2	0,0	88,9
Total	3133,7	3339,0	2035,9	1659,5	599,9	768,1	706,1

^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	6.13%		4.43%	4.57%	4.81%
15-35	6.13%		6.14%	5.97%	6.10%
36-60	—		6.19%	6.09%	6.10%
61-90	6.24%		6.19%	5.95%	6.00%
91-180	6.28%		6.00%	6.18%	6.19%
>180	6.90%		6.74%	6.33%	6.83%
Total	6.27%		5.61%	5.77%	5.81%

^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	141	148	6505	6823	27	144	5183	5354	39	220	6156	5752
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4040	3329	0	0	2610	2647	0	0	3450	2883
Otros ^c	148	141	926	1093	144	27	979	692	219	39	876	1733
Total	290	289	11471	11245	171	171	8772	8693	258	259	10482	10368

^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.