

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de junio de 2022
Fecha de Información: 06 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\$4015 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.00%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	835,8	1038,8	539,6	760,4	427,2	3,4	72,0
15-35	690,7	743,7	489,7	513,1	123,3	46,9	130,8
36-60	247,8	68,1	17,7	0,0	50,4	247,8	0,0
61-90	3,7	17,5	0,0	0,0	17,5	3,7	0,0
91-180	320,7	233,6	195,0	95,0	23,6	210,7	15,0
>180	13,3	19,0	15,0	10,0	4,0	3,3	0,0
Total	2111,9	2120,7	1257,0	1378,5	646,0	515,7	217,8

^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%		4.45%	4.81%	4.65%
15-35	5.63%		4.63%	4.74%	4.83%
36-60	-		5.86%	5.81%	5.82%
61-90	-		6.15%	5.94%	6.11%
91-180	6.14%		6.23%	6.06%	6.13%
>180	-		7.00%	6.37%	6.72%
Total	5.76%		4.74%	5.15%	5.00%

^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	06 – 10 jun.				13 - 17 jun.				20 - 24 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	91	237	5784	6126	51	224	9056	10056	30	200	4367	4613
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3539	3046	1	0	5614	4406	0	0	2393	1852
Otros ^c	237	91	854	721	223	51	1991	2058	200	30	660	869
Total	328	328	10177	9893	275	275	16661	16520	230	230	7420	7334

^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.