INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de junio de 2022
Fecha de Información: 01 de junio de 2022[1]

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$4272 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.10%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1000,5	1126,8	550,8	543,6	139,9	20,7	436,1
15-35	716,5	823,9	577,8	494,4	78,1	54,1	168,0
36-60	249,1	20,3	0,0	107,8	20,3	141,3	0,0
61-90	84,5	49,3	22,4	80,0	26,9	4,5	0,0
91-180	526,7	516,4	93,7	150,0	62,7	16,7	360,0
>180	59,0	102,7	46,3	19,0	16,4	0,0	40,0
Total	**2636,3**	**2639,4**	**1291,0**	**1394,8**	**344,3**	**237,3**	**1004,1**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	4.70%	5.49%	4.29%	4.77%
15-35	4.80%	4.92%	4.65%	4.80%
36-60	–	5.40%	5.19%	5.22%
61-90	–	5.67%	4.88%	5.39%
91-180	5.84%	5.90%	5.78%	5.85%
>180	6.33%	6.62%	6.57%	6.45%
Total	**5.19%**	**5.38%**	**4.67%**	**5.10%**

[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: ((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

	30 may. - 03 jun.				06 - 10 jun.				13 - 17 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	34	89	6896	6808	81	230	4932	5114	51	202	7999	8435
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	3466	3480	0	0	2863	2528	1	0	4963	3702
Otros[c]	89	34	1190	1195	229	81	833	703	201	51	1218	1912
Total	**123**	**123**	**11552**	**11483**	**310**	**311**	**8628**	**8345**	**253**	**253**	**14180**	**14049**

[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.