INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de junio de 2022
Fecha de Información: 13 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$2639 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.99%[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	567,4	405,0	271,2	322,5	66,8	177,8	67,0
15-35	614,6	949,1	525,2	330,8	173,2	33,1	250,6
36-60	114,2	75,7	40,0	0,5	5,7	83,7	30,0
61-90	12,3	9,8	0,0	0,0	9,8	12,3	0,0
91-180	98,9	77,0	24,8	50,0	35,2	31,9	17,0
>180	79,6	30,2	0,0	30,1	0,2	19,6	30,0
Total	**1487,0**	**1546,7**	**861,2**	**733,9**	**290,9**	**358,4**	**394,7**

[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	6.32%	6.34%	4.66%	5.20%
15-35	6.32%	6.36%	6.24%	6.33%
36-60	6.14%	6.17%	6.21%	6.19%
61-90	–	6.39%	5.98%	6.16%
91-180	6.40%	6.47%	6.23%	6.35%
>180	6.63%	6.72%	6.56%	6.59%
Total	**6.33%**	**6.36%**	**5.47%**	**5.99%**

[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

	13 – 17 jun.				20 - 24 jun.				27 jun. - 01 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	62	229	10799	11588	37	203	4666	5125	43	196	6225	6192
Intragrupo y off-shore[b]	1	0	6349	5517	0	0	2811	1888	3	0	3526	3394
Otros[c]	228	62	2311	2169	203	37	686	1046	193	43	955	939
Total	**291**	**291**	**19459**	**19274**	**240**	**240**	**8163**	**8059**	**239**	**239**	**10706**	**10525**

[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.