

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de julio de 2022
Fecha de Información: 01 de julio 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\$1945 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.28%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	267,0	357,2	197,9	105,7	31,3	33,2	128
15-35	642,8	794,8	546,8	375,0	19,0	38,8	229
36-60	6,9	5,1	2,2	0,2	3,0	6,6	0
61-90	26,0	97,9	85,0	0,0	2,9	16,0	10
91-180	32,0	18,0	0,0	0,0	18,0	32,0	0
>180	25,9	38,4	35,0	10,0	3,4	15,9	0
Total	1000,5	1311,4	866,8	491,0	77,6	142,5	367

^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	6.57%		5.51%	5.93%	5.92%
15-35	6.56%		6.52%	6.10%	6.39%
36-60	—		6.69%	6.11%	6.28%
61-90	6.59%		6.59%	6.27%	6.52%
91-180	—		6.71%	6.43%	6.53%
>180	—		7.00%	6.37%	6.81%
Total	6.56%		6.20%	6.13%	6.28%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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	18	25	1657	1454	32	146	5427	5796	44	220	6288	6041
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	732	916	0	0	2748	2675	0	0	3608	2898
Otros ^c	25	18	219	152	146	32	1116	740	219	44	930	1754
Total	43	43	2608	2522	178	178	9291	9211	263	264	10826	10693

^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.