

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de julio de 2022
Fecha de Información: 06 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\$3961 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.30%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	930,2	436,7	95,6	772,7	227,9	44,4	113,1
15-35	500,2	1236,4	984,9	179,9	48,0	116,8	203,5
36-60	245,1	12,3	2,9	1,6	9,4	243,5	0,0
61-90	228,2	419,5	291,6	22,3	23,9	101,9	104,0
91-180	167,0	43,9	20,0	119,8	23,9	47,1	0,0
>180	161,5	26,8	5,0	135,4	1,8	0,0	26,1
Total	2232,2	2175,7	1400,0	1231,6	335,0	553,8	446,7

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.45%	6.40%	5.85%	6.04%
15-35	6.42%	6.46%	6.33%	6.43%
36-60	—	6.51%	6.47%	6.47%
61-90	6.51%	6.54%	6.46%	6.50%
91-180	—	6.70%	6.41%	6.50%
>180	6.77%	6.73%	6.47%	6.71%
Total	6.47%	6.45%	6.10%	6.30%

^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	04 – 08 jul.				11 - 15 jul.				18 - 22 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	112	4449	4418	74	220	6490	6881	36	183	3918	4239
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2387	2573	0	0	3798	3004	0	0	2655	1617
Otros ^c	112	31	705	476	220	74	1517	1769	183	36	513	1192
Total	143	143	7541	7467	294	294	11805	11654	219	219	7086	7048

^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.