

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2022
Fecha de Información: 07 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\$3702 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.97%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	450,5	642,6	96,2	320,8	510,1	93,5	36,2
15-35	669,3	641,2	516,6	516,1	50,6	79,2	74,0
36-60	151,5	10,4	0,0	1,0	10,4	150,4	0,0
61-90	345,2	322,2	267,9	0,0	44,3	335,2	10,0
91-180	133,5	282,0	209,4	85,0	27,6	3,4	45,0
>180	154,0	124,9	60,0	85,8	4,9	8,1	60,0
Total	1903,9	2023,3	1150,1	1008,8	648,0	669,8	225,2

^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	6.33%		4.40%	7.07%	5.45%
15-35	6.30%		6.47%	6.22%	6.36%
36-60	—		6.61%	6.36%	6.38%
61-90	6.45%		6.49%	6.18%	6.24%
91-180	6.56%		6.02%	6.42%	6.20%
>180	6.68%		7.06%	3.62%	6.61%
Total	6.47%		5.39%	6.49%	5.97%

^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: ((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

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	18	77	3135	3306	75	221	6774	7521	36	183	3944	4311
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1949	1927	0	0	3910	3198	0	0	2708	1636
Otros ^c	77	18	419	221	220	75	2040	1854	183	36	530	1199
Total	95	95	5503	5454	295	296	12724	12573	219	219	7182	7146

^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.