

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2022
Fecha de Información: 08 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\$2875 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.70%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	580,7	294,3	125,5	374,1	60,7	98,5	108
15-35	1022,3	1211,4	589,5	350,0	99,9	150,3	522
36-60	61,2	7,8	0,0	0,0	7,8	61,2	0
61-90	146,6	61,8	0,0	65,4	16,8	36,2	45
91-180	22,7	47,4	0,0	0,0	27,4	2,7	20
>180	25,6	96,5	85,2	15,0	3,3	2,6	8
Total	1859,1	1719,3	800,2	804,6	216,0	351,5	703

^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	5.88%		5.07%	5.60%	5.52%
15-35	5.93%		5.48%	5.46%	5.64%
36-60	—		6.43%	6.00%	6.05%
61-90	6.26%		6.19%	6.18%	6.21%
91-180	6.24%		6.59%	6.12%	6.43%
>180	6.42%		6.78%	5.59%	6.62%
Total	5.96%		5.56%	5.63%	5.70%

^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	11	35	448	409	110	222	7308	7706	40	183	4004	4345
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	201	212	0	0	3951	3574	0	0	2723	1653
Otros ^c	35	11	86	106	221	110	2093	1915	183	40	538	1231
Total	46	46	735	727	331	332	13352	13195	223	223	7265	7229

^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.