

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2022
Fecha de Información: 11 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\$2999 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.05%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	465,6	638,2	225,6	285,0	282,9	50,8	129,7
15-35	1106,4	1085,5	397,5	346,1	24,0	96,3	664,0
36-60	10,0	13,7	0,0	0,0	13,7	10,0	0,0
61-90	25,3	14,3	6,0	0,5	8,3	24,8	0,0
91-180	267,8	111,2	90,9	0,0	10,3	257,8	10,0
>180	44,8	49,1	17,0	8,1	2,8	7,4	29,3
Total	1919,9	1911,8	737,0	639,7	341,8	447,1	833,0

^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	5.52%		3.45%	3.83%	3.84%
15-35	5.55%		5.51%	5.43%	5.51%
36-60	—		6.11%	5.70%	5.93%
61-90	—		6.14%	5.89%	5.98%
91-180	6.03%		5.75%	5.78%	5.78%
>180	6.56%		6.93%	6.11%	6.61%
Total	5.59%		4.60%	5.05%	5.05%

^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	11 – 15 jul.				18 - 22 jul.				25 - 29 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	117	223	7781	8212	44	184	4046	4466	33	240	6278	6566
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4065	3806	0	0	2836	1671	0	0	4087	2789
Otros ^c	222	117	2362	2032	184	44	546	1255	240	33	823	1790
Total	339	340	14208	14050	228	228	7428	7392	273	273	11188	11145

^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.