

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2022
Fecha de Información: 14 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\$2745 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.01%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	657,4	421,1	140,7	372,9	24,4	28,5	256,0
15-35	560,4	1330,9	907,1	154,8	23,5	5,3	400,3
36-60	4,9	23,6	0,0	0,2	20,6	1,7	3,0
61-90	134,9	36,9	15,0	94,4	21,9	40,4	0,0
91-180	35,6	40,7	10,0	0,0	20,7	25,6	10,0
>180	143,2	46,6	17,0	11,0	7,6	110,2	22,0
Total	1536,5	1899,9	1089,8	633,3	118,8	211,8	691,3

^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	4.91%		5.27%	3.71%	4.34%
15-35	5.25%		4.86%	5.24%	5.01%
36-60	5.16%		6.03%	5.27%	5.87%
61-90	—		6.11%	5.94%	6.01%
91-180	6.23%		6.33%	5.88%	6.11%
>180	7.13%		6.96%	7.12%	7.10%
Total	5.20%		5.04%	4.79%	5.01%

^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	26	97	3378	3810	48	196	4888	5711	34	259	6801	7055
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2076	1882	0	0	2931	2161	0	0	4219	2966
Otros ^c	97	26	988	712	195	48	1389	1300	259	34	889	1827
Total	123	123	6442	6404	243	244	9208	9172	293	293	11909	11848

^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.