

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2022
Fecha de Información: 19 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\$4344 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.82%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	1188,0	883,8	241,0	867,6	345,8	23,4	297
15-35	535,8	1371,7	1136,7	299,0	78,0	79,8	157
36-60	119,3	17,9	3,1	0,0	14,8	119,3	0
61-90	205,2	178,0	0,0	10,0	8,0	25,2	170
91-180	412,6	218,3	10,0	5,1	12,3	211,5	196
>180	9,6	23,4	15,0	3,1	8,4	6,5	0
Total	2470,6	2693,2	1405,9	1184,8	467,3	465,8	820

^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	6.32%		3.29%	5.87%	5.18%
15-35	6.29%		6.07%	6.09%	6.10%
36-60	—		6.71%	6.40%	6.44%
61-90	6.58%		6.79%	6.50%	6.58%
91-180	6.64%		7.00%	6.16%	6.41%
>180	—		7.52%	7.34%	7.48%
Total	6.44%		5.27%	6.02%	5.82%

^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	18 - 22 jul.				25 - 29 jul.				01 - 05 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	35	153	3953	4283	37	268	7508	7841	32	136	6221	6366
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2137	2120	0	0	4491	3499	0	0	4171	3254
Otros ^c	153	35	1187	840	268	37	1293	1886	136	32	295	1013
Total	188	188	7277	7243	305	305	13292	13226	168	168	10687	10633

^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.