

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2022
Fecha de Información: 22 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\$3015 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.22%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	235,5	351,5	62,3	115,1	225,6	56,8	63,6
15-35	503,0	628,7	448,2	303,1	50,5	69,9	130,0
36-60	3,4	217,1	205,0	0,0	12,1	3,4	0,0
61-90	54,3	271,4	216,0	0,0	5,4	4,3	50,0
91-180	562,7	230,6	140,0	307,7	10,6	175,0	80,0
>180	233,1	47,0	37,2	232,4	9,8	0,7	0,0
Total	1591,9	1746,3	1108,7	958,3	314,0	310,0	323,6

^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	6.59%		4.11%	5.70%	4.91%
15-35	6.62%		6.71%	6.56%	6.64%
36-60	—		6.71%	5.72%	6.49%
61-90	6.81%		6.82%	6.62%	6.81%
91-180	6.84%		6.62%	6.55%	6.62%
>180	—		7.34%	7.47%	7.36%
Total	6.70%		5.89%	6.38%	6.22%

^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	12	57	960	1004	45	271	8262	8875	47	136	6539	6757
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	248	295	0	0	4748	3880	0	0	4423	3413
Otros ^c	57	12	429	335	271	45	1853	2042	136	47	310	1047
Total	69	69	1637	1634	316	316	14863	14797	183	183	11272	11217

^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.