

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2022
Fecha de Información: 25 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\$2902 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.84%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	507,2	743,3	192,6	308,5	385,6	33,7	165,0
15-35	578,8	789,7	406,5	212,3	47,3	30,6	335,9
36-60	94,2	39,3	0,0	0,0	28,3	83,2	11,0
61-90	12,0	13,0	0,0	0,0	13,0	12,0	0,0
91-180	378,9	88,2	25,0	50,4	43,2	308,6	20,0
>180	180,1	151,6	1,5	32,0	7,3	5,4	142,7
Total	1751,3	1825,0	625,6	603,1	524,7	473,5	674,6

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.51%	3.67%	5.05%	4.54%
15-35	6.60%	6.34%	6.52%	6.48%
36-60	6.72%	6.82%	6.62%	6.67%
61-90	—	7.63%	6.70%	7.18%
91-180	6.80%	7.14%	6.48%	6.59%
>180	7.57%	7.62%	7.54%	7.57%
Total	6.79%	4.95%	6.08%	5.84%

^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	25 – 29 jul.				01 - 05 ago.				08 - 12 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	48	272	8566	9153	48	136	6686	7189	15	255	6139	5437
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4893	4084	0	0	4436	3477	0	0	3288	2732
Otros ^c	272	48	1892	2048	136	48	669	1071	255	15	560	1715
Total	320	320	15351	15285	184	184	11791	11737	270	270	9987	9884

^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.