

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2022
Fecha de Información: 27 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\$2769 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.43%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	412,5	536,8	198,8	77,5	127,1	124,0	211,0
15-35	477,9	933,3	578,7	246,9	163,8	40,2	190,8
36-60	64,9	32,5	6,0	0,0	16,5	54,9	10,0
61-90	80,2	47,4	0,0	25,0	17,4	25,2	30,0
91-180	453,1	100,4	45,0	367,8	25,4	55,3	30,0
>180	70,0	88,2	13,5	11,2	18,7	2,8	56,0
Total	1558,6	1738,5	842,0	728,4	368,8	302,5	527,8

^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	6.39%		6.48%	5.32%	6.13%
15-35	6.39%		6.26%	6.32%	6.30%
36-60	6.42%		6.79%	6.51%	6.57%
61-90	6.62%		6.78%	6.53%	6.62%
91-180	6.80%		7.01%	6.76%	6.78%
>180	7.58%		7.50%	7.40%	7.54%
Total	6.55%		6.39%	6.38%	6.43%

^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	43	189	6109	6481	54	137	6916	7897	24	258	6358	5732
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3436	2763	0	0	4539	3527	0	0	3438	2767
Otros ^c	189	43	1467	1694	137	54	1109	1086	258	24	614	1809
Total	232	232	11012	10938	191	191	12564	12510	282	282	10410	10308

^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.