

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de agosto de 2022
Fecha de Información: 29 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\$2295 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.56%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	405,3	375,2	97,9	225,1	105,2	8,0	172,2
15-35	733,1	793,7	343,5	422,5	209,6	70,0	240,6
36-60	36,4	62,0	0,0	0,0	54,6	29,1	7,4
61-90	44,3	95,9	1,1	0,0	54,8	4,3	40,0
91-180	62,6	81,1	34,0	55,0	42,1	2,6	5,0
>180	21,0	50,0	15,0	11,8	35,0	9,2	0,0
Total	1302,7	1457,9	491,5	714,4	501,2	123,2	465,1

^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	6.70%		6.53%	6.42%	6.56%
15-35	6.42%		6.53%	6.39%	6.46%
36-60	6.38%		6.66%	6.48%	6.58%
61-90	6.64%		6.91%	6.72%	6.79%
91-180	6.85%		7.06%	6.90%	7.01%
>180	—		7.46%	7.30%	7.42%
Total	6.55%		6.66%	6.45%	6.56%

^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	18	57	1615	1567	56	144	7384	8346	29	266	6405	5827
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	382	360	0	0	4761	3811	0	0	3469	2783
Otros ^c	57	18	659	665	144	56	1167	1099	266	29	656	1817
Total	75	75	2656	2592	200	200	13312	13256	295	295	10530	10427

^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.