

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2022
Fecha de Información: 15 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\$2306 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.45%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	309,6	456,0	286,2	260,8	151,9	30,8	18,0
15-35	538,7	792,2	494,5	300,0	63,1	4,1	234,6
36-60	132,9	12,8	0,0	0,0	12,8	132,9	0,0
61-90	212,1	90,5	10,0	150,0	20,5	2,1	60,0
91-180	21,6	18,9	0,0	10,0	18,9	11,6	0,0
>180	25,5	7,5	0,0	24,2	7,5	1,3	0,0
Total	1240,4	1377,9	790,7	745,0	274,6	182,7	312,6

^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	5.82%		5.84%	5.50%	5.65%
15-35	5.92%		5.24%	4.29%	5.13%
36-60	-		6.42%	5.90%	5.95%
61-90	6.44%		6.24%	6.06%	6.38%
91-180	-		6.77%	6.36%	6.55%
>180	-		7.51%	7.58%	7.56%
Total	6.02%		5.48%	5.17%	5.45%

^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.

¹A 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.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	11 – 15 jul.				18 - 22 jul.				25 - 29 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	9	65	863	1178	50	198	5090	5865	35	262	6830	7168
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	469	328	0	0	2961	2339	0	0	4298	2982
Otros ^c	65	9	571	393	198	50	1504	1315	262	35	923	1840
Total	74	74	1903	1899	248	248	9555	9519	297	297	12051	11990

^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.