

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2022
Fecha de Información: 18 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\$3241 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.56%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	261,6	445,7	146,1	161,4	234,6	35,2	65,0
15-35	941,1	1059,5	634,6	569,7	69,4	15,9	355,5
36-60	8,7	16,8	0,0	0,0	16,8	8,7	0,0
61-90	43,2	207,9	180,5	30,0	27,5	13,2	0,0
91-180	273,1	203,7	100,7	0,0	33,1	203,1	70,0
>180	123,4	166,8	129,7	101,1	17,1	2,3	20,0
Total	1651,0	2100,4	1191,5	862,2	398,5	278,3	510,5

^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	6.18%		2.62%	5.84%	3.97%
15-35	6.01%		5.96%	5.86%	5.97%
36-60	-		6.66%	6.02%	6.44%
61-90	-		6.70%	6.39%	6.62%
91-180	6.61%		6.93%	6.29%	6.44%
>180	7.10%		7.53%	7.43%	7.33%
Total	6.16%		4.89%	6.08%	5.56%

^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.

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	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	52	201	5399	6184	36	267	6932	7233	30	136	6140	6182
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3010	2487	0	0	4324	3041	0	0	4048	3254
Otros ^c	201	52	1702	1403	267	36	952	1869	136	30	291	1008
Total	253	253	10111	10074	303	303	12208	12143	166	166	10479	10444

^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.