INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2022
Fecha de Información: 13 de julio de 2022[1]

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$3131 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.25%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	665,0	667,9	99,9	459,5	380,3	17,8	187,7
15-35	694,6	958,7	649,3	399,3	62,3	48,2	247,0
36-60	161,2	28,1	0,0	0,0	28,1	161,2	0,0
61-90	57,5	28,2	0,0	29,6	17,3	17,0	10,9
91-180	56,6	172,5	97,0	0,6	25,5	6,0	50,0
>180	110,8	55,3	15,0	76,2	10,3	4,5	30,0
Total	**1745,7**	**1910,7**	**861,3**	**965,3**	**523,9**	**254,8**	**525,6**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.05%	5.14%	5.08%	5.10%
15-35	5.08%	5.11%	4.99%	5.07%
36-60	–	5.75%	5.24%	5.32%
61-90	5.86%	5.90%	5.62%	5.78%
91-180	5.99%	6.09%	6.06%	6.06%
>180	7.40%	7.12%	7.03%	7.14%
Total	**5.30%**	**5.27%**	**5.21%**	**5.25%**

[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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	11 – 15 jul.				18 - 22 jul.				25 - 29 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	40	131	5329	5591	46	194	4490	5534	33	255	6721	6930
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2714	2709	0	0	2896	1923	0	0	4137	2928
Otros[c]	131	40	1834	1491	194	46	1388	1280	255	33	873	1821
Total	**171**	**171**	**9877**	**9791**	**240**	**240**	**8774**	**8737**	**288**	**288**	**11731**	**11679**

[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.