INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2022
Fecha de Información: 21 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$3616 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.11%[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	901,4	1065,7	441,4	471,7	352,5	157,9	271,8
15-35	665,3	1165,6	614,6	219,9	139,5	34,0	411,5
36-60	166,6	18,3	4,7	11,0	13,6	155,6	0,0
61-90	43,5	38,6	0,4	20,0	18,2	3,5	20,0
91-180	359,2	202,2	64,0	0,0	8,2	0,0	359,2
>180	42,7	19,2	0,0	32,2	9,2	0,6	10,0
Total	**2178,8**	**2509,6**	**1125,1**	**754,7**	**541,2**	**351,6**	**1072,5**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	7.09%	4.60%	5.91%	5.58%
15-35	6.66%	6.47%	6.37%	6.53%
36-60	–	6.95%	6.48%	6.53%
61-90	6.69%	6.94%	6.47%	6.78%
91-180	6.73%	6.85%	6.34%	6.51%
>180	7.13%	7.54%	7.72%	7.42%
Total	**6.82%**	**5.62%**	**6.15%**	**6.11%**

[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

	18 – 22 jul.				25 - 29 jul.				01 - 05 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	19	115	2902	3111	42	269	8084	8594	32	136	6404	6609
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1584	1540	0	0	4708	3769	0	0	4361	3355
Otros[c]	115	19	790	597	269	42	1640	2004	136	32	299	1046
Total	**134**	**134**	**5276**	**5248**	**311**	**311**	**14432**	**14367**	**168**	**168**	**11064**	**11010**

[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.