INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de agosto de 2022
Fecha de Información: 01 de agosto 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$1996 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.88%[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	321,9	392,8	171,3	241,9	162,4	20,9	59,1
15-35	244,1	500,3	315,0	149,3	119,1	28,6	66,2
36-60	330,8	155,6	80,4	50,0	35,2	240,8	40,0
61-90	3,1	42,4	27,4	0,0	15,0	3,1	0,0
91-180	26,4	60,9	32,0	25,5	28,9	0,9	0,0
>180	57,0	35,8	17,8	47,0	8,0	0,0	10,0
Total	**983,3**	**1187,9**	**643,9**	**513,7**	**368,7**	**294,4**	**175,2**

[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	7.30%	6.92%	6.42%	6.92%
15-35	6.96%	7.04%	6.76%	6.94%
36-60	6.82%	6.86%	6.70%	6.74%
61-90	–	7.12%	6.90%	7.08%
91-180	–	7.16%	6.95%	7.15%
>180	6.93%	7.38%	–	7.13%
Total	**7.04%**	**6.98%**	**6.68%**	**6.88%**

[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

	01 – 05 ago.				08 - 12 ago.				15 - 19 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	59	144	7835	8594	30	268	6718	6354	9	154	2861	4826
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	4932	4124	0	0	3560	2802	0	0	3165	1291
Otros[c]	144	59	1171	1164	268	30	814	1833	154	9	687	543
Total	**203**	**203**	**13938**	**13882**	**298**	**298**	**11092**	**10989**	**163**	**163**	**6713**	**6660**

[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.