INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2022
Fecha de Información: 25 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$1678 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.16%[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	232,0	279,0	251,9	190,8	16,1	30,2	11,0
15-35	564,7	437,7	288,0	401,0	22,5	36,4	127,3
36-60	7,9	2,2	0,0	0,0	2,2	7,9	0,0
61-90	96,1	31,1	20,0	75,0	1,1	11,1	10,0
91-180	10,7	143,2	90,0	0,0	53,2	10,7	0,0
>180	9,6	12,5	0,0	1,4	12,5	8,1	0,0
Total	**920,9**	**905,7**	**649,9**	**668,2**	**107,6**	**104,3**	**148,3**

[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	6.09%	5.51%	5.97%	5.74%
15-35	6.15%	6.29%	6.07%	6.15%
36-60	–	6.52%	5.81%	5.97%
61-90	6.45%	6.65%	6.67%	6.60%
91-180	–	6.95%	6.68%	6.93%
>180	–	7.75%	7.09%	7.46%
Total	**6.17%**	**6.24%**	**6.08%**	**6.16%**

[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

	22 – 26 ago.				29 ago. - 02 sept.				05 - 09 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	19	122	2267	2260	46	188	6931	7452	21	152	3376	3579
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1364	1131	0	0	4401	3532	0	0	2347	1691
Otros[c]	122	19	474	694	188	46	1227	1531	152	21	387	784
Total	**141**	**141**	**4105**	**4085**	**234**	**234**	**12559**	**12515**	**173**	**173**	**6110**	**6054**

[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.