

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de agosto de 2022
Fecha de Información: 02 de agosto 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\$2824 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.67%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	705,6	864,7	360,6	335,1	142,1	8,5	362,0
15-35	630,2	818,0	391,3	218,6	31,9	16,9	394,7
36-60	306,3	49,1	0,0	0,0	39,1	296,3	10,0
61-90	0,1	13,4	0,0	0,0	13,4	0,1	0,0
91-180	9,9	62,8	40,0	0,0	20,4	7,5	2,4
>180	100,3	122,5	30,0	10,0	2,5	0,3	90,0
Total	1752,5	1930,5	822,0	563,7	249,4	329,7	859,1

^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	6.93%	6.18%	6.72%	6.61%
15-35	6.47%	6.44%	6.71%	6.51%
36-60	6.70%	6.87%	6.66%	6.68%
61-90	—	6.91%	6.70%	6.91%
91-180	6.83%	6.83%	6.25%	6.77%
>180	8.59%	7.05%	6.86%	8.26%
Total	6.89%	6.39%	6.69%	6.67%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	01 – 05 ago.				08 - 12 ago.				15 - 19 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	107	6507	7027	31	269	6826	6753	10	155	2914	4896
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4325	3759	0	0	3764	2848	0	0	3185	1299
Otros ^c	107	47	559	549	269	31	949	1835	155	10	701	553
Total	154	154	11391	11335	300	300	11539	11436	165	165	6800	6748

^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.