

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de agosto de 2022
Fecha de Información: 03 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\$2182 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.66%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	505,4	318,1	172,4	393,9	83,9	49,7	61,8
15-35	535,1	757,7	405,0	213,3	67,7	36,8	285,0
36-60	98,4	65,0	0,0	6,0	55,0	82,4	10,0
61-90	45,7	105,0	50,0	0,0	10,0	0,7	45,0
91-180	21,1	44,8	28,8	15,0	10,9	0,9	5,1
>180	52,7	65,5	34,8	10,0	5,3	17,4	25,4
Total	1258,4	1356,1	690,9	638,2	232,9	187,9	432,3

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.94%	6.15%	6.49%	6.41%
15-35	6.85%	6.69%	6.76%	6.76%
36-60	6.83%	6.94%	6.67%	6.78%
61-90	6.77%	7.07%	6.83%	6.94%
91-180	6.87%	6.85%	6.85%	6.85%
>180	6.88%	7.10%	6.73%	6.87%
Total	6.86%	6.59%	6.61%	6.66%

^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.

¹A 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.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{365}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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	41	91	5742	5968	37	269	6950	6945	10	155	2978	4948
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3825	3418	0	0	3879	2957	0	0	3205	1320
Otros ^c	91	41	312	445	269	37	1024	1848	155	10	716	580
Total	132	132	9879	9831	306	306	11853	11750	165	165	6899	6848

^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.