

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de agosto de 2022
Fecha de Información: 04 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\$1941 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.14%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	506,8	409,8	367,8	479,5	41,9	27,2	0,1
15-35	310,4	564,6	395,7	163,0	39,3	17,7	129,6
36-60	29,7	92,5	40,8	8,0	51,7	21,7	0,0
61-90	30,9	76,0	31,7	0,0	14,1	0,7	30,2
91-180	30,3	57,4	0,0	0,0	27,4	0,3	30,0
>180	11,7	16,1	0,0	4,3	11,1	2,4	5,0
Total	919,9	1216,4	836,0	654,8	185,5	70,0	195,0

^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	7.00%	4.75%	6.22%	5.53%
15-35	6.90%	6.60%	6.02%	6.51%
36-60	—	7.08%	6.76%	6.96%
61-90	6.85%	7.07%	6.56%	6.91%
91-180	6.85%	7.08%	6.76%	6.96%
>180	7.01%	7.28%	7.06%	7.16%
Total	6.89%	5.92%	6.20%	6.14%

^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	24	67	4671	4762	39	270	7098	7334	11	157	3296	4989
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3119	2681	0	0	4247	3067	0	0	3206	1601
Otros ^c	67	24	106	410	270	39	1027	1868	157	11	752	606
Total	91	91	7896	7853	309	309	12372	12269	168	168	7254	7196

^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.