

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de agosto de 2022
Fecha de Información: 05 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\$2657 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.89%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	444,3	975,0	508,7	327,1	361,4	12,4	104,9
15-35	579,8	353,4	130,7	368,3	27,7	16,5	195,0
36-60	6,4	23,5	0,3	0,0	23,2	6,4	0,0
61-90	8,3	5,3	0,0	0,0	5,3	8,3	0,0
91-180	404,6	83,7	35,0	20,0	13,7	349,6	35,0
>180	19,6	98,3	75,0	0,0	13,3	9,6	10,0
Total	1463,0	1539,3	749,7	715,4	444,7	402,7	344,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.71%		4.73%	6.31%	5.34%
15-35	6.73%		6.63%	6.49%	6.62%
36-60	—		6.93%	6.67%	6.87%
61-90	—		7.28%	5.45%	6.17%
91-180	6.89%		6.99%	6.42%	6.49%
>180	6.90%		7.13%	6.86%	6.98%
Total	6.75%		5.10%	6.39%	5.89%

^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: ((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

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	8	34	893	955	40	272	7274	8281	12	159	3615	5004
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	521	247	0	0	4757	3154	0	0	3206	1905
Otros ^c	34	8	47	244	272	40	1379	1872	158	12	758	613
Total	42	42	1461	1446	312	312	13410	13307	170	171	7579	7522

^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.