

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2022
Fecha de Información: 10 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\$2110 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.38%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	690,3	151,7	45,8	615,7	67,9	36,6	38,0
15-35	384,5	406,2	277,5	300,0	67,3	23,2	61,4
36-60	62,5	43,0	0,0	0,8	42,9	61,7	0,1
61-90	0,9	13,0	0,0	0,0	12,9	0,8	0,1
91-180	62,9	77,0	25,6	20,0	31,4	22,9	20,0
>180	51,5	310,4	272,5	10,0	12,9	16,5	25,0
Total	1252,8	1001,3	621,5	946,5	235,3	161,8	144,5

^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	6.49%	6.76%	5.93%	6.13%
15-35	6.43%	6.47%	6.22%	6.35%
36-60	6.63%	6.71%	6.44%	6.55%
61-90	6.80%	6.81%	5.84%	6.75%
91-180	6.72%	6.95%	6.67%	6.81%
>180	6.97%	7.04%	6.92%	7.01%
Total	6.58%	6.67%	6.13%	6.38%

^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	08 – 12 ago.				15 - 19 ago.				22 - 26 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	41	212	5535	6112	17	162	4220	5252	24	215	3589	4007
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3445	2390	0	0	3247	2343	0	0	2064	1286
Otros ^c	212	41	1111	1492	161	17	875	690	215	24	754	1085
Total	253	253	10091	9994	178	179	8342	8285	239	239	6407	6378

^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.