

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2022
Fecha de Información: 11 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\$2256 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.15%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	431,4	489,0	234,3	259,5	110,0	27,2	144,7
15-35	602,0	681,8	342,7	322,0	0,0	6,9	273,1
36-60	55,2	154,6	106,5	0,0	48,1	55,2	0,0
61-90	2,8	20,4	0,0	0,0	20,4	2,8	0,0
91-180	84,5	93,4	0,0	30,0	43,3	4,3	50,1
>180	52,0	57,0	50,0	50,0	7,0	2,0	0,0
Total	1227,7	1496,1	733,5	661,4	228,8	98,4	467,9

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.26%	6.43%	5.02%	5.80%
15-35	6.02%	6.15%	6.24%	6.14%
36-60	—	6.63%	6.30%	6.45%
61-90	—	6.71%	4.05%	6.39%
91-180	6.82%	6.89%	6.76%	6.83%
>180	—	7.02%	6.99%	7.00%
Total	6.18%	6.39%	5.87%	6.15%

^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	39	94	4632	5217	17	171	4393	5383	26	226	3759	4243
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3013	2055	0	0	3271	2463	0	0	2181	1304
Otros ^c	94	39	956	1274	170	17	940	701	226	26	782	1147
Total	133	133	8601	8546	187	188	8604	8547	252	252	6722	6694

^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.