

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2022
Fecha de Información: 12 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\$2885 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.19%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	649,4	786,6	81,3	357,2	501,0	88,0	204,3
15-35	483,5	614,6	323,1	294,2	134,7	0,0	189,3
36-60	53,1	53,0	0,0	0,0	48,9	49,1	4,0
61-90	42,9	81,3	21,9	20,0	39,3	2,9	20,0
91-180	401,3	118,2	0,0	5,0	78,2	356,3	40,0
>180	17,3	41,3	28,6	0,2	12,7	17,1	0,0
Total	1647,5	1694,9	454,9	676,6	814,9	513,3	457,6

^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	6.41%		2.19%	4.27%	3.57%
15-35	6.38%		6.26%	6.05%	6.22%
36-60	6.30%		6.66%	6.34%	6.49%
61-90	6.60%		6.58%	6.57%	6.58%
91-180	6.81%		7.00%	5.96%	6.20%
>180	—		7.25%	7.12%	7.21%
Total	6.45%		4.49%	5.47%	5.19%

^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	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	31	60	1613	1796	22	229	4832	5624	26	231	3799	4683
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	661	447	0	0	3351	2687	0	0	2197	1329
Otros ^c	60	31	788	808	228	22	965	780	231	26	1195	1152
Total	91	91	3062	3051	250	251	9148	9091	257	257	7191	7164

^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.