

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2022
Fecha de Información: 16 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\$2272 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.16%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	684,3	364,1	110,9	500,3	97,2	28,1	156
15-35	351,1	649,8	581,0	265,2	0,0	53,9	32
36-60	40,6	50,5	42,6	20,0	7,9	20,6	0
61-90	7,2	14,1	0,0	0,0	14,1	7,2	0
91-180	91,6	182,6	80,0	0,0	102,6	91,6	0
>180	6,7	22,0	9,2	0,0	7,8	1,7	5
Total	1181,5	1283,0	823,6	785,5	229,6	203,0	193

^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	7.01%	2.97%	6.40%	5.85%
15-35	6.41%	6.45%	6.01%	6.33%
36-60	—	6.63%	6.31%	6.49%
61-90	—	5.41%	6.31%	5.72%
91-180	—	6.69%	6.21%	6.46%
>180	7.04%	7.15%	7.00%	7.12%
Total	6.91%	5.90%	6.27%	6.16%

^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	15 – 19 ago.				22 - 26 ago.				29 ago. - 02 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	25	229	5437	5741	29	232	3983	4888	28	181	6057	6030
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3392	3102	1	0	2243	1420	0	0	3828	3118
Otros ^c	229	25	970	900	232	29	1280	1170	181	28	702	1421
Total	254	254	9799	9743	262	261	7506	7478	209	209	10587	10569

^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.