

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2022
Fecha de Información: 17 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\$2940 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.37%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	766,1	675,3	182,9	432,1	212,8	54,5	279,5
15-35	460,4	887,7	677,9	204,3	0,0	107,5	148,6
36-60	265,3	23,8	0,0	50,0	23,8	215,3	0,0
61-90	17,5	41,5	0,0	0,0	41,5	17,5	0,0
91-180	67,5	83,1	10,4	20,0	32,7	7,5	40,0
>180	86,5	108,3	30,2	10,0	3,2	1,7	74,8
Total	1663,3	1819,7	901,5	716,3	314,1	404,1	542,9

^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	6.53%	6.55%	5.89%	6.28%
15-35	6.44%	6.33%	6.20%	6.32%
36-60	—	6.60%	6.46%	6.47%
61-90	—	6.80%	6.58%	6.74%
91-180	6.67%	6.93%	6.63%	6.77%
>180	7.20%	7.12%	6.91%	7.19%
Total	6.61%	6.46%	6.14%	6.37%

^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	22	189	4434	4514	33	233	4231	5317	29	181	6239	6117
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2575	2489	1	0	2354	1510	0	0	3873	3240
Otros ^c	189	22	946	900	233	33	1473	1198	181	29	720	1439
Total	211	211	7955	7903	267	266	8058	8025	210	210	10832	10796

^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.