

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2022
Fecha de Información: 18 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\$2160 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.34%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	676,5	465,3	142,4	415,2	127,8	66,2	195,1
15-35	373,5	778,6	606,0	117,6	57,5	0,0	255,9
36-60	133,0	7,1	0,0	0,0	7,1	133,0	0,0
61-90	38,7	76,2	30,0	0,0	26,2	18,7	20,0
91-180	26,8	12,7	0,0	7,5	12,7	19,3	0,0
>180	24,3	28,1	13,0	2,4	5,1	11,9	10,0
Total	1272,9	1367,9	791,4	542,7	236,3	249,2	481,0

^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	6.87%	6.52%	5.30%	6.19%
15-35	6.51%	6.27%	6.48%	6.37%
36-60	—	6.67%	6.38%	6.40%
61-90	6.49%	6.85%	6.43%	6.67%
91-180	—	7.04%	6.62%	6.79%
>180	6.99%	7.13%	6.81%	6.96%
Total	6.73%	6.42%	6.04%	6.34%

^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	20	149	3325	3213	37	236	4792	5857	31	181	6489	6439
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2122	2025	1	0	2402	1648	0	0	3968	3250
Otros ^c	149	20	440	605	236	37	1595	1252	181	31	723	1456
Total	169	169	5887	5843	274	273	8789	8757	212	212	11180	11145

^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.