

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2022
Fecha de Información: 19 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\$2445 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.46%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	835,5	610,9	135,2	357,3	17,7	20,2	458,0
15-35	519,8	625,3	386,2	279,2	41,3	42,9	197,8
36-60	12,5	113,0	0,0	0,0	108,7	8,2	4,2
61-90	52,1	87,5	61,6	0,0	10,9	37,1	15,0
91-180	82,3	183,8	110,7	19,0	23,1	13,3	50,0
>180	13,6	33,8	28,4	10,0	5,5	3,6	0,0
Total	1515,7	1654,3	722,1	665,5	207,1	125,1	725,1

^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%	5.90%	6.01%	6.29%
15-35	6.47%	6.24%	6.45%	6.35%
36-60	6.48%	7.83%	6.41%	7.68%
61-90	6.79%	6.80%	6.50%	6.62%
91-180	6.75%	6.87%	6.56%	6.82%
>180	—	7.22%	6.89%	7.09%
Total	6.54%	6.55%	6.24%	6.46%

^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	11	96	628	625	37	237	5019	5962	34	181	6635	6501
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	322	279	1	0	2465	1833	0	0	4009	3358
Otros ^c	96	11	126	147	237	37	1607	1256	181	34	729	1469
Total	107	107	1076	1051	275	274	9091	9051	215	215	11373	11328

^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.