

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2022
Fecha de Información: 22 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\$2148 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.47%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	388,9	372,9	289,0	231,5	14,0	87,3	70
15-35	499,8	556,1	347,8	338,7	97,3	50,1	111
36-60	47,3	18,3	11,7	30,5	6,5	16,8	0
61-90	79,5	4,8	2,4	73,8	2,4	5,7	0
91-180	58,7	152,1	93,0	0,0	19,1	18,7	40
>180	29,3	171,6	160,0	10,0	1,6	9,3	10
Total	1103,5	1275,8	903,9	684,6	140,9	188,0	231

^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	6.60%	6.15%	5.80%	6.01%
15-35	6.48%	6.53%	6.43%	6.49%
36-60	—	6.75%	6.64%	6.65%
61-90	—	6.87%	6.62%	6.73%
91-180	6.96%	6.96%	6.75%	6.93%
>180	7.17%	7.23%	6.81%	7.20%
Total	6.63%	6.68%	6.16%	6.47%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	22 – 26 ago.				29 ago. - 02 sep.				05 - 09 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	41	239	5383	6192	36	181	6653	6643	17	146	3304	3458
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2613	2051	0	0	4150	3372	0	0	2238	1650
Otros ^c	238	41	1619	1332	181	36	730	1474	146	17	383	762
Total	280	280	9615	9575	217	217	11533	11489	163	163	5925	5870

^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.