

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2022
Fecha de Información: 23 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\$2222 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.89%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	303,3	468,4	102,0	239,5	325,3	0,0	63,8
15-35	298,8	624,1	442,6	98,3	11,6	0,0	200,4
36-60	193,7	109,5	0,0	45,0	24,5	63,7	85,0
61-90	84,7	31,9	0,0	75,0	31,9	9,7	0,0
91-180	396,9	137,7	12,0	10,0	25,7	286,9	100,0
>180	9,5	18,2	10,0	0,0	3,2	4,5	5,0
Total	1286,8	1389,8	566,6	467,8	422,2	364,7	454,2

^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	6.39%	3.40%	6.36%	4.46%
15-35	6.41%	6.39%	6.37%	6.40%
36-60	6.73%	6.83%	6.43%	6.63%
61-90	—	7.01%	6.85%	6.89%
91-180	6.94%	7.05%	6.49%	6.64%
>180	7.13%	7.41%	7.13%	7.20%
Total	6.62%	5.04%	6.48%	5.89%

^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	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	40	204	5102	5569	38	181	6771	7075	18	152	3311	3553
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2246	1801	0	0	4227	3436	0	0	2328	1650
Otros ^c	204	40	1498	1445	181	38	1045	1488	152	18	386	765
Total	245	244	8846	8815	219	219	12043	11999	170	170	6025	5968

^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.