

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2022
Fecha de Información: 24 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\$2189 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.96%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	376,1	372,1	128,0	263,7	182,1	50,3	62,0
15-35	368,6	654,0	428,8	169,1	0,0	25,5	174,0
36-60	20,3	5,9	0,3	15,5	5,6	4,8	0,0
61-90	82,9	29,8	0,0	60,0	9,8	2,9	20,0
91-180	334,8	143,1	45,0	66,8	23,1	193,0	75,0
>180	133,3	132,8	20,0	0,0	2,8	0,0	133,3
Total	1316,0	1337,7	622,1	575,1	223,4	276,5	464,3

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.38%		3.01%	6.09%	4.06%
15-35	6.23%		6.33%	6.21%	6.27%
36-60	—		6.67%	6.38%	6.44%
61-90	6.64%		8.15%	6.59%	6.77%
91-180	6.94%		7.08%	6.62%	6.73%
>180	7.46%		7.37%	7.10%	7.39%
Total	6.74%		5.05%	6.43%	5.96%

^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	35	173	3308	3550	41	188	6805	7302	20	153	3356	3577
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	1701	1629	0	0	4283	3436	0	0	2347	1686
Otros ^c	172	35	920	725	188	41	1216	1522	153	20	385	769
Total	208	208	5929	5904	229	229	12304	12260	173	173	6088	6032

^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.