

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2022
Fecha de Información: 26 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\$1852 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.08%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	298,7	593,7	322,0	238,5	237,7	26,3	34
15-35	407,7	349,6	156,7	260,6	67,8	22,1	125
36-60	22,2	9,7	0,0	16,5	9,7	5,7	0
61-90	1,2	18,8	10,0	0,0	8,8	1,2	0
91-180	244,8	42,5	0,0	23,0	32,5	211,8	10
>180	20,7	14,4	7,2	15,6	4,2	2,1	3
Total	995,4	1028,7	495,9	554,1	360,8	269,2	172

^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	5.93%		2.56%	5.92%	3.64%
15-35	5.96%		6.19%	5.89%	6.05%
36-60	—		6.60%	6.20%	6.32%
61-90	—		6.88%	6.51%	6.84%
91-180	6.69%		7.16%	6.04%	6.20%
>180	7.01%		7.44%	7.46%	7.38%
Total	6.01%		4.07%	6.02%	5.08%

^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	6	77	299	413	51	195	7206	7767	22	152	3402	3821
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	280	81	0	0	4675	3768	0	0	2372	1703
Otros ^c	77	6	81	166	195	51	1245	1542	152	22	601	794
Total	83	83	660	660	246	246	13126	13077	174	174	6375	6318

^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.