

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2022
Fecha de Información: 08 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\$1949 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.24%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	353,5	327,0	207,7	324,6	113,3	22,9	6,0
15-35	401,9	443,3	245,8	266,9	69,8	7,4	127,6
36-60	33,6	145,4	107,8	5,5	17,6	8,1	20,0
61-90	2,4	11,7	0,0	0,0	11,7	2,4	0,0
91-180	105,4	166,8	130,0	0,0	16,7	85,3	20,1
>180	121,2	25,8	10,0	90,0	0,8	16,2	15,0
Total	1018,0	1120,0	701,3	687,0	229,9	142,3	188,7

^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	6.56%		6.73%	4.51%	5.50%
15-35	6.54%		6.04%	6.58%	6.30%
36-60	6.70%		6.89%	6.64%	6.75%
61-90	-		6.86%	6.68%	6.83%
91-180	6.90%		6.78%	6.76%	6.79%
>180	6.98%		7.29%	6.98%	6.99%
Total	6.63%		6.46%	5.86%	6.24%

^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.

¹A 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.

²El 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	08 – 12 ago.				15 - 19 ago.				22 - 26 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	40	274	7535	8565	14	159	3750	5011	24	202	3520	3949
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4936	3279	0	0	3206	2022	0	0	2044	1254
Otros ^c	274	40	1483	2002	159	14	766	631	202	24	737	1070
Total	314	314	13954	13846	173	173	7722	7664	226	226	6301	6273

^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.