

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2022
Fecha de Información: 29 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\$3982 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.74%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	514,3	816,4	274,5	256,3	359,3	75,4	182,6
15-35	1076,1	795,7	213,2	576,8	123,5	0,0	499,4
36-60	217,7	62,5	17,7	0,0	13,8	186,7	31,0
61-90	4,0	33,7	29,0	0,0	4,7	4,0	0,0
91-180	648,9	884,9	491,0	97,5	23,9	181,4	370,0
>180	7,9	3,3	0,0	0,0	3,3	7,9	0,0
Total	2469,0	2596,4	1025,4	930,6	528,4	455,4	1083,0

^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	5.97%		6.04%	3.35%	5.48%
15-35	5.99%		5.93%	3.68%	4.96%
36-60	6.43%		6.68%	6.01%	6.10%
61-90	-		6.83%	6.44%	6.65%
91-180	6.90%		6.61%	6.74%	6.74%
>180	-		7.45%	6.91%	7.07%
Total	6.33%		6.25%	4.73%	5.74%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	29 ago. - 02 sep.				05 - 09 sep.				12 - 16 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	52	196	7612	8267	31	153	3522	4145	38	189	4508	5295
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4887	3939	0	0	2429	1810	0	0	2462	1711
Otros ^c	196	52	1367	1611	153	31	858	797	189	38	1463	1136
Total	248	248	13866	13817	184	184	6809	6752	227	227	8433	8142

^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.