

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 01 de septiembre de 2022<sup>1</sup>**

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\$1945 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.06%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	323,7	396,4	294,8	192,7	47,6	77,0	54
15-35	631,6	773,3	374,2	275,6	0,0	50,0	306
36-60	5,3	30,7	0,0	0,0	30,7	5,3	0
61-90	2,2	27,0	20,0	0,0	7,0	2,2	0
91-180	16,3	29,0	11,5	16,0	17,5	0,3	0
>180	24,4	60,6	42,0	0,0	2,6	8,4	16
<b>Total</b>	<b>1003,5</b>	<b>1317,0</b>	<b>742,6</b>	<b>484,3</b>	<b>105,4</b>	<b>143,2</b>	<b>376</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	6.16%		6.10%	5.92%	6.04%
15-35	6.14%		5.87%	5.81%	5.94%
36-60	-		6.63%	6.21%	6.57%
61-90	-		6.65%	6.39%	6.62%
91-180	-		6.99%	7.04%	7.00%
>180	7.04%		7.07%	6.90%	7.04%
<b>Total</b>	<b>6.19%</b>		<b>6.12%</b>	<b>5.89%</b>	<b>6.06%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	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 <sup>a</sup>	22	64	3183	3438	37	153	3930	4809	48	191	5265	6204
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2412	2070	0	0	2729	2031	0	0	2612	1914
Otros <sup>c</sup>	64	22	248	326	153	37	1121	883	191	48	1682	1146
<b>Total</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>5843</b>	<b>5834</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>7780</b>	<b>7723</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>9559</b>	<b>9264</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.