

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$1945 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.06%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		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
Total	1003,5	1317,0	742,6	484,3	105,4	143,2	376

^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	6.16%	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%
Total	6.19%	6.12%	5.89%	6.06%

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

^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.