

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 02 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\$3382 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.27%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	939,0	381,8	288,1	829,4	9,7	25,6	84,0
15-35	640,2	1326,1	1036,5	354,3	36,5	32,7	253,1
36-60	3,7	6,1	0,0	0,0	6,1	3,7	0,0
61-90	10,2	189,3	187,0	0,0	2,3	10,2	0,0
91-180	6,3	104,2	90,0	2,2	14,2	4,1	0,0
>180	61,8	70,1	46,0	27,4	4,1	14,3	20,0
<b>Total</b>	<b>1661,2</b>	<b>2077,6</b>	<b>1647,6</b>	<b>1213,4</b>	<b>72,9</b>	<b>90,7</b>	<b>357,1</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	6.24%	6.24%	6.18%	6.21%
15-35	6.24%	6.19%	6.17%	6.20%
36-60	—	6.86%	6.13%	6.58%
61-90	—	6.76%	6.55%	6.75%
91-180	—	6.48%	6.83%	6.53%
>180	7.33%	7.22%	7.19%	7.24%
<b>Total</b>	<b>6.31%</b>	<b>6.31%</b>	<b>6.20%</b>	<b>6.27%</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ { (365 / \text{Plazo})}) - 1$ . 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 <sup>a</sup>	8	42	940	993	38	157	4743	5008	50	191	5360	6364
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	774	706	0	0	2918	2833	0	0	2691	1914
Otros <sup>c</sup>	42	8	155	161	157	38	1126	889	191	50	1684	1161
<b>Total</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>1869</b>	<b>1860</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>8787</b>	<b>8730</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>9735</b>	<b>9439</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.