

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 02 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\$3382 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.27%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
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
Total	1661,2	2077,6	1647,6	1213,4	72,9	90,7	357,1

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
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%
Total	6.31%		6.31%	6.20%	6.27%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	8	42	940	993	38	157	4743	5008	50	191	5360	6364
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	774	706	0	0	2918	2833	0	0	2691	1914
Otros ^c	42	8	155	161	157	38	1126	889	191	50	1684	1161
Total	50	50	1869	1860	195	195	8787	8730	241	241	9735	9439

^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.