

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 05 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\$148 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.43%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	17,4	25,3	18	13,0	7,3	4,4	0
15-35	65,0	53,0	14	22,8	3,0	6,2	36
36-60	0,7	3,1	0	0,0	3,1	0,7	0
61-90	5,4	1,5	0	0,0	1,5	5,4	0
91-180	0,1	6,2	0	0,0	6,2	0,1	0
>180	5,3	6,3	0	0,0	1,3	0,3	5
Total	93,8	95,4	32	35,8	22,4	17,1	41

^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	—	6.31%	6.75%	6.49%
15-35	6.36%	6.26%	5.98%	6.24%
36-60	—	6.57%	6.32%	6.52%
61-90	—	6.89%	6.49%	6.58%
91-180	—	7.27%	6.83%	7.27%
>180	7.31%	7.13%	7.05%	7.27%
Total	6.48%	6.47%	6.34%	6.43%

^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	05 – 09 sep.				12 - 16 sep.				19 - 23 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	43	156	4764	5026	51	196	5360	6365	15	175	7037	7592
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2936	2855	0	0	2691	1914	0	0	4033	2630
Otros ^c	156	43	1126	888	196	51	1685	1161	175	15	990	1812
Total	199	199	8826	8769	247	247	9736	9440	190	190	12060	12034

^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.