

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 06 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\$3198 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.64%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	428,5	744,7	293,5	339,8	381,2	18,7	70,0
15-35	870,9	776,2	503,0	423,8	0,0	244,2	203,0
36-60	166,2	192,0	160,0	0,0	26,8	161,0	5,3
61-90	59,8	8,8	0,0	56,0	8,6	3,6	0,1
91-180	12,0	107,6	80,0	10,0	27,6	2,0	0,0
>180	9,6	104,9	90,0	0,0	9,9	4,6	5,0
<b>Total</b>	<b>1546,9</b>	<b>1934,2</b>	<b>1126,5</b>	<b>829,6</b>	<b>454,1</b>	<b>434,0</b>	<b>283,4</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	6.68%	6.55%	6.55%	6.56%
15-35	6.66%	6.64%	6.60%	6.63%
36-60	6.60%	6.89%	6.61%	6.65%
61-90	6.92%	7.16%	2.78%	5.87%
91-180	—	7.28%	7.05%	7.27%
>180	7.25%	7.52%	7.18%	7.40%
<b>Total</b>	<b>6.67%</b>	<b>6.69%</b>	<b>6.58%</b>	<b>6.64%</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	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 <sup>a</sup>	43	156	5146	5514	52	196	5486	6665	17	176	7309	7659
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3275	3038	0	0	2691	1997	0	0	4061	2835
Otros <sup>c</sup>	156	43	1224	1036	196	52	1950	1169	176	17	1009	1849
<b>Total</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>9645</b>	<b>9588</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>10127</b>	<b>9831</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>12379</b>	<b>12343</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.