

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 06 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\$3198 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.64%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	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
Total	1546,9	1934,2	1126,5	829,6	454,1	434,0	283,4

^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	6.68%		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%
Total	6.67%		6.69%	6.58%	6.64%

^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	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	5146	5514	52	196	5486	6665	17	176	7309	7659
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3275	3038	0	0	2691	1997	0	0	4061	2835
Otros ^c	156	43	1224	1036	196	52	1950	1169	176	17	1009	1849
Total	199	199	9645	9588	248	248	10127	9831	193	193	12379	12343

^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.