

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 07 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\$2431 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.16%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	752,6	558,3	145,5	530,2	207,2	16,8	205,6
15-35	813,5	725,8	416,0	264,3	50,8	0,0	549,2
36-60	40,2	179,5	131,7	0,0	17,8	10,2	30,0
61-90	2,9	50,9	40,8	0,0	10,1	2,9	0,0
91-180	1,0	56,2	10,0	0,2	46,2	0,9	0,0
>180	19,7	28,7	11,2	6,0	4,5	0,7	13,0
Total	1629,8	1599,4	755,2	800,6	336,6	31,4	797,8

^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	6.71%		6.67%	4.09%	5.58%
15-35	6.73%		6.05%	6.69%	6.45%
36-60	7.06%		7.07%	6.61%	6.99%
61-90	—		7.24%	6.98%	7.18%
91-180	—		7.39%	6.96%	7.38%
>180	7.81%		7.73%	7.12%	7.76%
Total	6.77%		6.41%	5.50%	6.16%

^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	22	104	3563	3781	55	196	5679	6961	17	178	7613	7764
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2465	2275	0	0	2691	2088	0	0	4062	3037
Otros ^c	104	22	529	457	196	55	2151	1176	178	17	1014	1852
Total	126	126	6557	6513	251	251	10521	10225	195	195	12689	12653

^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.