

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 08 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\$3434 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.42%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	638,3	625,6	151,8	460,8	315,7	19,5	158,0
15-35	886,8	939,6	674,0	370,0	39,6	290,8	226,0
36-60	98,4	16,1	0,0	0,0	8,7	91,0	7,4
61-90	180,7	376,9	220,0	75,0	56,9	5,7	100,0
91-180	20,2	79,3	55,0	20,0	24,3	0,2	0,0
>180	26,2	37,8	30,0	10,0	7,8	16,2	0,0
Total	1850,6	2075,3	1130,8	935,8	453,1	423,4	491,4

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.17%	6.81%	4.97%	6.01%
15-35	6.81%	6.23%	6.70%	6.50%
36-60	7.02%	7.25%	6.75%	6.81%
61-90	7.21%	7.38%	7.17%	7.25%
91-180	—	7.53%	7.00%	7.53%
>180	—	7.85%	7.63%	7.70%
Total	6.69%	6.58%	6.07%	6.42%

^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	18	67	2213	2494	56	205	5957	7487	17	184	7929	7953
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1777	1566	0	0	2802	2233	0	0	4160	3262
Otros ^c	67	18	278	193	205	56	2445	1189	184	17	1019	1856
Total	85	85	4268	4253	261	261	11204	10909	201	201	13108	13071

^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.