

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 30 de agosto 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\$4869 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.99%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	413,7	555,2	176,1	254,9	305,6	85,3	73,5
15-35	1669,3	1285,1	345,7	877,5	0,0	61,2	730,6
36-60	110,7	56,6	0,0	30,0	26,6	50,7	30,0
61-90	129,8	14,1	0,0	0,0	14,1	129,8	0,0
91-180	724,5	962,5	489,1	65,0	13,1	199,1	460,4
>180	44,8	215,4	195,0	20,0	1,9	6,3	18,5
Total	3092,7	3088,9	1205,9	1247,4	361,2	532,3	1313,0

^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	5.89%		4.29%	5.61%	4.94%
15-35	5.94%		5.86%	5.79%	5.87%
36-60	6.38%		6.55%	6.08%	6.29%
61-90	-		6.72%	6.32%	6.36%
91-180	6.82%		6.87%	6.40%	6.72%
>180	7.14%		7.20%	7.01%	7.16%
Total	6.27%		5.73%	5.96%	5.99%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	29 ago. - 02 sep.				05 - 09 sep.				12 - 16 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	46	172	6384	6788	32	152	3632	4351	43	189	4885	5826
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3864	3242	0	0	2471	1852	0	0	2492	1780
Otros ^c	172	46	1162	1352	152	32	971	816	189	43	1664	1140
Total	218	218	11410	11382	184	184	7074	7019	232	232	9041	8746

^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.