

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 31 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\$3068 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.23%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	833,9	696,6	246,7	496,4	126,9	14,5	323,0
15-35	715,1	809,1	438,3	266,5	64,3	142,0	306,5
36-60	41,4	9,7	2,6	0,0	3,3	37,6	3,8
61-90	64,3	66,3	50,0	63,1	16,3	1,2	0,0
91-180	89,2	133,9	40,0	0,0	8,2	3,5	85,7
>180	160,3	209,0	160,0	105,0	7,0	13,3	42,0
Total	1904,1	1924,6	937,6	931,0	226,0	212,2	760,9

^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	6.05%		6.02%	6.04%	6.04%
15-35	6.01%		6.05%	5.98%	6.01%
36-60	6.12%		6.58%	5.35%	5.52%
61-90	-		6.71%	6.39%	6.71%
91-180	6.84%		6.85%	6.91%	6.84%
>180	7.40%		7.16%	7.08%	7.18%
Total	6.20%		6.40%	6.09%	6.23%

^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	35	128	5140	5376	32	153	3862	4619	44	191	5128	6104
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3201	2817	0	0	2567	2024	0	0	2548	1798
Otros ^c	128	35	855	968	153	32	1094	823	191	44	1666	1144
Total	163	163	9196	9161	185	185	7523	7466	235	235	9342	9046

^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.