

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2022**  
**Fecha de Información: 19 de septiembre de 2022<sup>1</sup>**

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\$2666 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.76%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	456,6	790,9	100,8	235,8	517,1	47,8	173,0
15-35	357,2	666,9	450,9	81,0	50,0	110,2	166,0
36-60	61,8	22,0	0,0	35,0	7,5	12,3	14,5
61-90	68,9	5,3	0,0	0,0	5,3	68,9	0,0
91-180	421,2	52,1	0,0	160,0	37,1	246,2	15,0
>180	112,5	19,7	10,0	10,0	9,7	102,5	0,0
<b>Total</b>	<b>1478,1</b>	<b>1556,8</b>	<b>561,7</b>	<b>521,8</b>	<b>626,6</b>	<b>587,8</b>	<b>368,5</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	7.18%		5.76%	6.85%	6.24%
15-35	7.05%		6.96%	6.77%	6.93%
36-60	7.16%		7.32%	6.79%	7.06%
61-90	-		7.60%	7.30%	7.32%
91-180	7.48%		7.50%	7.32%	7.35%
>180	-		7.82%	7.57%	7.61%
<b>Total</b>	<b>7.13%</b>		<b>6.26%</b>	<b>7.13%</b>	<b>6.76%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	19 – 23 sep.				26 - 30 sep.				03 - 07 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	25	197	10488	10924	24	204	6809	7400	20	139	5620	6213
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	4971	5176	0	0	3883	3360	0	0	4136	2527
Otros <sup>c</sup>	197	25	2742	2065	204	24	1311	1218	139	20	526	1517
<b>Total</b>	<b>223</b>	<b>222</b>	<b>18201</b>	<b>18165</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>12003</b>	<b>11978</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>10282</b>	<b>10257</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.