

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 20 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\$1976 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.20%<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	674,8	819,5	39,0	167,2	291,5	18,6	489
15-35	385,0	479,2	222,5	147,5	33,8	14,5	223
36-60	92,2	46,3	0,0	0,0	11,3	57,2	35
61-90	0,7	73,9	0,0	0,0	73,9	0,7	0
91-180	55,3	93,3	55,8	32,0	17,5	3,3	20
>180	18,9	8,5	0,0	10,0	3,5	3,9	5
<b>Total</b>	<b>1226,9</b>	<b>1520,7</b>	<b>317,3</b>	<b>356,7</b>	<b>431,4</b>	<b>98,3</b>	<b>772</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	7.32%		7.09%	6.85%	7.20%
15-35	7.18%		7.15%	7.01%	7.13%
36-60	7.24%		7.46%	7.07%	7.17%
61-90	-		7.41%	6.64%	7.40%
91-180	7.36%		7.65%	7.15%	7.47%
>180	7.71%		8.27%	7.27%	7.72%
<b>Total</b>	<b>7.28%</b>		<b>7.18%</b>	<b>6.98%</b>	<b>7.20%</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>	27	161	5561	5966	25	204	7072	7806	20	140	5683	6318
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	2771	2870	0	0	3883	3451	0	0	4136	2527
Otros <sup>c</sup>	160	27	1476	949	204	25	1551	1225	140	20	571	1520
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>9808</b>	<b>9785</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>12506</b>	<b>12482</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>10390</b>	<b>10365</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.