

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 21 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\$2476 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.89%<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	485,9	540,6	99,5	389,8	359,1	14,1	82,0
15-35	385,0	708,7	510,4	150,5	23,2	59,3	175,2
36-60	222,0	11,1	0,0	0,0	11,1	222,0	0,0
61-90	267,1	36,0	5,0	162,7	24,6	98,0	6,4
91-180	23,9	62,1	0,0	0,0	42,1	3,9	20,0
>180	6,7	15,2	0,0	0,0	10,2	1,7	5,0
<b>Total</b>	<b>1390,6</b>	<b>1373,7</b>	<b>614,9</b>	<b>703,1</b>	<b>470,3</b>	<b>398,9</b>	<b>288,6</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	7.06%		7.21%	5.48%	6.54%
15-35	7.20%		6.98%	7.11%	7.08%
36-60	-		7.19%	7.21%	7.21%
61-90	7.22%		7.30%	7.19%	7.21%
91-180	7.41%		7.23%	3.66%	7.08%
>180	7.40%		7.86%	7.35%	7.68%
<b>Total</b>	<b>7.18%</b>		<b>7.14%</b>	<b>6.53%</b>	<b>6.89%</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>	23	138	4016	4288	27	208	7195	8088	21	141	5701	6501
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	2007	2091	0	0	3891	3516	0	0	4171	2527
Otros <sup>c</sup>	138	23	1077	705	208	27	1770	1227	141	21	705	1524
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>161</b>	<b>7100</b>	<b>7084</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>12856</b>	<b>12831</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>10577</b>	<b>10552</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.