

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 21 de septiembre 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\$2476 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.89%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	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
Total	1390,6	1373,7	614,9	703,1	470,3	398,9	288,6

^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	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%
Total	7.18%		7.14%	6.53%	6.89%

^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	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 ^a	23	138	4016	4288	27	208	7195	8088	21	141	5701	6501
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2007	2091	0	0	3891	3516	0	0	4171	2527
Otros ^c	138	23	1077	705	208	27	1770	1227	141	21	705	1524
Total	162	161	7100	7084	235	235	12856	12831	162	162	10577	10552

^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.