

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 13 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\$4444 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	928,1	976,2	235,2	742,5	608,8	53,4	132,2
15-35	507,4	1363,9	997,8	227,2	95,4	9,5	270,7
36-60	449,0	126,0	50,8	10,0	21,2	385,0	54,0
61-90	18,8	7,4	0,3	0,0	7,1	18,8	0,0
91-180	234,0	177,9	70,0	147,9	27,1	5,3	80,9
>180	69,4	163,6	110,0	26,0	13,6	3,4	40,0
Total	2206,7	2815,0	1464,1	1153,6	773,2	475,4	577,8

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.75%		6.87%	5.34%	6.14%
15-35	6.78%		6.62%	6.83%	6.67%
36-60	7.16%		7.23%	7.02%	7.05%
61-90	—		7.48%	7.06%	7.17%
91-180	7.36%		7.53%	7.24%	7.40%
>180	7.66%		7.71%	7.61%	7.67%
Total	6.95%		6.79%	6.04%	6.55%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	12 – 16 sep.				19 - 23 sep.				26 - 30 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	41	164	6484	7851	21	192	9225	9745	22	199	6137	5753
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2837	2363	1	0	4490	4218	0	0	3117	3253
Otros ^c	163	41	2404	1224	192	21	2302	2018	199	22	878	1101
Total	205	205	11725	11438	214	213	16017	15981	221	221	10132	10107

^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.