

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 13 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\$4444 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
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
<b>Total</b>	<b>2206,7</b>	<b>2815,0</b>	<b>1464,1</b>	<b>1153,6</b>	<b>773,2</b>	<b>475,4</b>	<b>577,8</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	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%
<b>Total</b>	<b>6.95%</b>	<b>6.79%</b>	<b>6.04%</b>	<b>6.55%</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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 <sup>a</sup>	41	164	6484	7851	21	192	9225	9745	22	199	6137	5753
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	2837	2363	1	0	4490	4218	0	0	3117	3253
Otros <sup>c</sup>	163	41	2404	1224	192	21	2302	2018	199	22	878	1101
<b>Total</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>11725</b>	<b>11438</b>	<b>214</b>	<b>213</b>	<b>16017</b>	<b>15981</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>10132</b>	<b>10107</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.