

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 14 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\$3145 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.53%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	834,9	894,3	581,4	724,3	214,4	12,1	98,5
15-35	280,4	700,8	574,5	183,1	42,8	13,8	83,5
36-60	115,5	32,6	10,0	0,0	7,3	100,2	15,2
61-90	3,0	98,5	57,6	0,0	40,8	3,0	0,0
91-180	169,9	66,6	0,0	148,4	46,6	1,5	20,0
>180	117,0	48,8	40,0	20,0	8,8	97,0	0,0
Total	1520,7	1841,4	1263,5	1075,8	360,7	227,6	217,3

^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	6.92%		6.93%	4.85%	5.93%
15-35	6.88%		6.50%	6.90%	6.62%
36-60	7.10%		7.16%	7.06%	7.08%
61-90	—		7.24%	6.99%	7.23%
91-180	7.43%		7.62%	7.33%	7.55%
>180	—		7.88%	7.70%	7.74%
Total	6.97%		6.83%	5.97%	6.53%

^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.

¹ 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.

² 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 ^a	32	146	6144	6789	21	193	9580	10260	22	201	6237	6313
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2590	2695	1	0	4696	4467	0	0	3635	3312
Otros ^c	145	32	1857	818	192	21	2511	2025	201	22	885	1107
Total	178	178	10591	10302	214	214	16787	16752	223	223	10757	10732

^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.