

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 15 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\$2937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.51%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	549,9	643,0	371,0	279,9	107,0	105,0	165
15-35	771,6	663,7	378,3	499,5	100,4	87,1	185
36-60	2,1	4,4	0,0	0,0	4,4	2,1	0
61-90	55,5	23,2	0,0	40,0	8,2	0,5	15
91-180	46,4	257,1	230,0	46,0	27,1	0,4	0
>180	127,6	172,5	155,0	10,0	2,5	102,6	15
Total	1553,1	1763,8	1134,3	875,4	249,5	297,7	380

^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	6.86%		6.22%	5.34%	5.98%
15-35	6.76%		6.78%	6.50%	6.68%
36-60	—		7.58%	6.76%	7.32%
61-90	7.12%		7.67%	7.11%	7.20%
91-180	—		7.42%	7.35%	7.41%
>180	7.48%		7.69%	7.45%	7.54%
Total	6.84%		6.69%	6.14%	6.51%

^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	30	97	3630	3656	21	194	9791	10527	23	201	6315	6441
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1917	2025	1	0	4861	4648	0	0	3745	3325
Otros ^c	97	30	747	602	193	21	2613	2054	201	23	888	1158
Total	127	127	6294	6283	215	215	17265	17229	224	224	10948	10924

^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.