

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 15 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\$2937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.51%<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	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
<b>Total</b>	<b>1553,1</b>	<b>1763,8</b>	<b>1134,3</b>	<b>875,4</b>	<b>249,5</b>	<b>297,7</b>	<b>380</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	6.86%	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%
<b>Total</b>	<b>6.84%</b>	<b>6.69%</b>	<b>6.14%</b>	<b>6.51%</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>	30	97	3630	3656	21	194	9791	10527	23	201	6315	6441
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1917	2025	1	0	4861	4648	0	0	3745	3325
Otros <sup>c</sup>	97	30	747	602	193	21	2613	2054	201	23	888	1158
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>6294</b>	<b>6283</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>17265</b>	<b>17229</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>10948</b>	<b>10924</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.