

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 23 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\$1984 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.35%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	309,0	306,0	138,2	211,5	114,8	44,5	53,0
15-35	412,5	631,9	420,5	224,8	0,0	106,6	81,1
36-60	21,3	64,8	60,0	0,0	4,8	21,3	0,0
61-90	73,4	65,2	53,5	25,0	3,7	40,4	8,0
91-180	8,3	23,2	0,0	0,0	23,2	8,3	0,0
>180	130,0	100,4	75,0	70,0	5,4	40,0	20,0
Total	954,5	1191,6	747,2	531,2	151,9	261,1	162,1

^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	7.39%		7.41%	7.03%	7.28%
15-35	7.35%		7.43%	7.27%	7.37%
36-60	—		7.51%	7.26%	7.31%
61-90	7.40%		7.42%	7.31%	7.36%
91-180	—		7.51%	7.22%	7.44%
>180	7.37%		7.47%	7.38%	7.38%
Total	7.37%		7.43%	7.24%	7.35%

^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	19 – 23 sep.				26 - 30 sep.				03 - 07 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	8	41	823	949	30	218	7641	8268	22	145	5834	6993
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	182	112	0	0	3994	3856	0	0	4282	2562
Otros ^c	41	8	377	312	218	30	1796	1282	145	22	1038	1575
Total	49	49	1382	1373	248	248	13431	13406	167	167	11154	11130

^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.