

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 23 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\$1984 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.35%<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
	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
<b>Total</b>	<b>954,5</b>	<b>1191,6</b>	<b>747,2</b>	<b>531,2</b>	<b>151,9</b>	<b>261,1</b>	<b>162,1</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	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%
<b>Total</b>	<b>7.37%</b>	<b>7.43%</b>	<b>7.24%</b>	<b>7.35%</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	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 <sup>a</sup>	8	41	823	949	30	218	7641	8268	22	145	5834	6993
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	182	112	0	0	3994	3856	0	0	4282	2562
Otros <sup>c</sup>	41	8	377	312	218	30	1796	1282	145	22	1038	1575
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>1382</b>	<b>1373</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>13431</b>	<b>13406</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>11154</b>	<b>11130</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.