INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 12 de septiembre de 2022[1]

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$4731 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.63%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	845,7	1025,0	271,1	518,0	589,9	163,6	164
15-35	654,5	1355,9	1072,2	308,1	41,7	104,3	242
36-60	253,5	142,6	93,6	53,5	32,0	182,9	17
61-90	2,7	28,7	0,6	1,1	28,1	1,6	0
91-180	589,2	240,5	85,0	305,0	135,5	264,2	20
>180	22,6	13,2	9,0	10,0	4,2	12,6	0
Total	**2368,2**	**2805,9**	**1531,5**	**1195,7**	**831,4**	**729,4**	**443**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.90%	4.04%	4.05%	4.37%
15-35	6.78%	5.35%	6.84%	5.89%
36-60	7.04%	7.23%	6.95%	7.01%
61-90	–	7.41%	7.15%	7.39%
91-180	7.39%	7.38%	7.17%	7.25%
>180	–	7.77%	7.66%	7.72%
Total	**6.86%**	**5.17%**	**5.87%**	**5.63%**

[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: ((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

	12 – 16 sep.				19 - 23 sep.				26 - 30 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	67	212	6767	8532	21	191	8922	8917	22	198	6039	5628
Intragrupo y off-shore[b]	1	0	3179	2562	0	0	4325	4019	0	0	3067	3218
Otros[c]	212	67	2673	1230	191	21	1704	1979	198	22	853	1088
Total	**280**	**279**	**12619**	**12324**	**212**	**212**	**14951**	**14915**	**220**	**220**	**9959**	**9934**

[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.