INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 16 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$1760 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.07%[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	526,2	334,4	133,0	334,1	38,4	29,1	163,0
15-35	276,8	768,1	569,4	77,9	44,5	44,7	154,1
36-60	5,7	6,4	0,0	0,0	6,4	5,7	0,0
61-90	17,8	31,3	7,0	0,0	9,3	2,8	15,0
91-180	15,2	71,0	41,3	15,1	29,7	0,1	0,0
>180	25,2	36,6	5,0	0,0	8,6	2,2	23,0
Total	**866,9**	**1247,8**	**755,7**	**427,2**	**136,9**	**84,6**	**355,1**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.97%	6.91%	7.59%	7.19%
15-35	6.91%	6.91%	6.79%	6.89%
36-60	–	7.18%	6.52%	6.87%
61-90	7.10%	7.29%	6.41%	7.13%
91-180	–	7.48%	7.24%	7.46%
>180	7.85%	7.71%	7.54%	7.79%
Total	**7.01%**	**6.99%**	**7.31%**	**7.07%**

[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]	21	55	528	611	23	196	10224	10686	23	202	6414	6615
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	88	132	1	0	4891	4969	0	0	3848	3346
Otros[c]	55	21	360	233	196	23	2639	2063	202	23	899	1175
Total	**76**	**76**	**976**	**976**	**220**	**219**	**17754**	**17718**	**225**	**225**	**11161**	**11136**

[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.