INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 22 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$2741 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.13%[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	620,9	599,7	115,4	245,5	259,2	0,0	375,4
15-35	704,7	834,9	356,0	374,5	157,7	9,1	321,1
36-60	2,6	16,6	0,0	0,0	16,6	2,6	0,0
61-90	212,0	151,0	115,0	0,3	26,0	201,8	10,0
91-180	96,6	131,2	30,0	45,0	51,2	1,6	50,0
>180	85,5	107,2	35,0	20,0	7,2	0,5	65,0
Total	**1722,4**	**1840,5**	**651,5**	**685,2**	**517,9**	**215,6**	**821,6**

[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	7.50%	7.19%	6.15%	6.89%
15-35	7.40%	7.42%	7.35%	7.40%
36-60	–	7.46%	4.42%	7.05%
61-90	7.39%	6.03%	7.13%	6.75%
91-180	7.44%	7.56%	7.32%	7.49%
>180	7.61%	7.76%	7.51%	7.60%
Total	**7.46%**	**7.18%**	**6.76%**	**7.13%**

[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

	19 – 23 sep.				26 - 30 sep.				03 - 07 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	18	89	3048	3338	27	218	7386	8176	21	145	5799	6804
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1457	1264	0	0	3940	3650	0	0	4208	2557
Otros[c]	89	18	741	638	218	27	1779	1254	145	21	940	1563
Total	**107**	**107**	**5246**	**5240**	**245**	**245**	**13105**	**13080**	**166**	**166**	**10947**	**10924**

[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.