

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2022**  
**Fecha de Información: 26 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\$2080 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.28%<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         | 267,7                          | 411,4         | 167,5                               | 127,4        | 139,6         | 35,9         | 104,3              |
| 15-35        | 714,4                          | 517,2         | 289,7                               | 430,4        | 20,6          | 77,1         | 207,0              |
| 36-60        | 142,7                          | 14,7          | 5,0                                 | 1,8          | 4,7           | 135,9        | 5,0                |
| 61-90        | 20,3                           | 177,5         | 159,5                               | 5,3          | 7,9           | 5,0          | 10,0               |
| 91-180       | 20,9                           | 47,1          | 10,0                                | 0,0          | 37,1          | 20,9         | 0,0                |
| >180         | 44,3                           | 27,9          | 25,0                                | 12,6         | 2,9           | 31,7         | 0,0                |
| <b>Total</b> | <b>1210,3</b>                  | <b>1195,8</b> | <b>656,7</b>                        | <b>577,4</b> | <b>212,7</b>  | <b>306,6</b> | <b>326,3</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 |              |              |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas                                    |  | Compras                      | Ventas       | Total        |
| 3-14         | 7.38%   |  | 7.23%                        | 7.12%        | 7.23%        |
| 15-35        | 7.35%   |  | 7.42%                        | 7.18%        | 7.32%        |
| 36-60        | 7.41%   |  | 7.48%                        | 7.29%        | 7.30%        |
| 61-90        | 7.28%   |  | 7.31%                        | 7.18%        | 7.30%        |
| 91-180       | —   |  | 7.52%                        | 6.88%        | 7.29%        |
| >180         | —   |  | 7.50%                        | 7.00%        | 7.17%        |
| <b>Total</b> | <b>7.36%</b>                                      |  | <b>7.34%</b>                 | <b>7.17%</b> | <b>7.28%</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: ((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

| Sectores                            | 26 – 30 sep. |            |              |              | 03 - 07 oct. |            |              |              | 10 - 14 oct. |            |             |             |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
|                                     | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery     |            | NDF         |             |
|                                     | C            | V          | C            | V            | C            | V          | C            | V            | C            | V          | C           | V           |
| Sector Financiero <sup>a</sup>      | 35           | 219        | 7777         | 8562         | 26           | 146        | 5955         | 7104         | 31           | 138        | 3854        | 4723        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 4131         | 3949         | 0            | 0          | 4313         | 2597         | 0            | 0          | 3199        | 1605        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 219          | 35         | 1932         | 1294         | 146          | 26         | 1048         | 1589         | 138          | 31         | 513         | 1202        |
| <b>Total</b>                        | <b>254</b>   | <b>254</b> | <b>13840</b> | <b>13805</b> | <b>172</b>   | <b>172</b> | <b>11316</b> | <b>11290</b> | <b>169</b>   | <b>169</b> | <b>7566</b> | <b>7530</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.