

# 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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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.