

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 27 de septiembre de 2022¹

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\$1683 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.30%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	331,6	308,5	153,0	203,7	114,9	87,3	40,6
15-35	395,2	422,8	293,9	187,7	10,8	89,3	118,1
36-60	69,4	50,5	30,0	32,5	5,5	21,9	15,0
61-90	34,2	12,2	6,4	5,0	5,8	29,2	0,0
91-180	122,7	65,3	0,0	0,0	55,3	112,7	10,0
>180	40,9	22,7	10,0	0,0	3,2	31,4	9,5
Total	993,9	882,0	493,3	428,9	195,4	371,8	193,3

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.27%	7.86%	6.93%	7.39%
15-35	7.24%	7.25%	7.21%	7.23%
36-60	7.31%	7.29%	7.17%	7.26%
61-90	—	7.35%	7.19%	7.23%
91-180	7.26%	7.36%	7.25%	7.28%
>180	7.40%	7.54%	7.22%	7.33%
Total	7.26%	7.50%	7.12%	7.30%

^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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$. 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 ^a	35	197	6649	7357	42	146	6013	7210	40	139	3877	4735
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3983	3785	0	0	4319	2615	0	0	3209	1605
Otros ^c	197	35	1124	581	146	42	1148	1629	139	40	515	1224
Total	232	232	11756	11723	188	188	11480	11454	179	179	7601	7564

^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.