

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 28 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\$3001 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.97%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	778,2	438,2	134,3	528,4	141,9	87,7	162,0
15-35	801,6	929,9	523,7	447,2	105,2	0,0	354,5
36-60	1,1	47,3	35,0	0,0	12,3	1,1	0,0
61-90	64,7	204,0	155,2	22,0	8,8	2,7	40,0
91-180	185,4	52,1	5,0	38,0	24,1	124,4	23,0
>180	46,1	51,5	15,0	20,0	16,5	6,1	20,0
Total	1877,1	1723,1	868,2	1055,6	308,9	222,0	599,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	7.22%		7.15%	5.27%	6.34%
15-35	7.22%		7.29%	7.23%	7.25%
36-60	—		7.39%	7.02%	7.36%
61-90	7.27%		7.29%	7.30%	7.29%
91-180	7.37%		7.50%	7.31%	7.35%
>180	7.54%		7.68%	7.34%	7.55%
Total	7.24%		7.28%	6.43%	6.97%

^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.

¹A 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.

²El 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	29	177	6041	6181	44	149	6220	7512	40	141	3972	4861
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3420	3517	0	0	4404	2736	0	0	3259	1616
Otros ^c	177	29	845	585	149	44	1282	1632	141	40	519	1238
Total	206	206	10306	10283	193	193	11906	11880	181	181	7750	7715

^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.