

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de octubre de 2022**

**Fecha de Información: 29 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\$2507 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.86%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	514,8	410,9	210,3	204,2	29,6	139,7	171
15-35	923,1	656,6	265,1	621,2	132,5	42,9	259
36-60	69,9	1,9	0,0	54,5	1,9	15,4	0
61-90	30,9	190,8	173,2	0,0	12,7	25,9	5
91-180	16,7	28,7	0,0	0,0	28,7	16,7	0
>180	2,2	95,9	70,0	0,0	25,9	2,2	0
<b>Total</b>	<b>1557,6</b>	<b>1384,8</b>	<b>718,6</b>	<b>879,8</b>	<b>231,2</b>	<b>242,7</b>	<b>435</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	7.24%	6.80%	5.12%	6.24%
15-35	7.10%	7.26%	7.04%	7.13%
36-60	—	7.67%	7.17%	7.22%
61-90	7.20%	7.23%	7.07%	7.20%
91-180	—	7.47%	7.19%	7.37%
>180	—	7.51%	7.02%	7.49%
<b>Total</b>	<b>7.15%</b>	<b>7.17%</b>	<b>6.29%</b>	<b>6.86%</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>	19	103	3922	4269	51	149	6413	7803	48	141	4162	4932
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2370	2026	0	0	4580	2801	0	0	3287	1737
Otros <sup>c</sup>	103	19	589	564	149	51	1293	1656	141	48	527	1270
<b>Total</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>6881</b>	<b>6859</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>12286</b>	<b>12260</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>7976</b>	<b>7939</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.