

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de octubre de 2022
Fecha de Información: 29 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\$2507 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.86%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	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
Total	1557,6	1384,8	718,6	879,8	231,2	242,7	435

^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	7.24%		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%
Total	7.15%		7.17%	6.29%	6.86%

^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: ((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 ^a	19	103	3922	4269	51	149	6413	7803	48	141	4162	4932
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2370	2026	0	0	4580	2801	0	0	3287	1737
Otros ^c	103	19	589	564	149	51	1293	1656	141	48	527	1270
Total	122	122	6881	6859	200	200	12286	12260	189	189	7976	7939

^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.