

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de octubre de 2022
Fecha de Información: 30 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\$2956 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.99%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	439,2	476,9	196,8	86,5	12,3	84,9	267,8
15-35	809,1	1134,3	661,8	269,5	58,6	125,8	413,8
36-60	80,5	12,2	0,0	50,0	12,2	30,5	0,0
61-90	36,5	175,1	156,8	0,0	8,3	26,5	10,0
91-180	207,4	16,1	0,0	200,0	16,1	7,4	0,0
>180	197,2	82,8	56,0	160,5	6,8	16,7	20,0
Total	1770,0	1897,2	1071,5	766,6	114,3	291,9	711,5

^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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	6.97%		6.95%	6.72%	6.91%
15-35	6.95%		7.02%	6.81%	6.95%
36-60	—		7.78%	6.87%	7.12%
61-90	6.97%		7.10%	6.97%	7.05%
91-180	—		7.33%	6.94%	7.08%
>180	7.20%		7.31%	7.31%	7.30%
Total	6.96%		7.05%	6.95%	6.99%

^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	10	56	803	895	56	150	6645	8032	50	141	4338	5178
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	448	460	0	0	4680	2843	0	0	3383	1758
Otros ^c	56	10	290	186	150	56	1300	1724	141	50	532	1280
Total	66	66	1541	1541	206	206	12625	12599	191	191	8253	8216

^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.