

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de octubre de 2022**

**Fecha de Información: 30 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\$2956 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.99%<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	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
<b>Total</b>	<b>1770,0</b>	<b>1897,2</b>	<b>1071,5</b>	<b>766,6</b>	<b>114,3</b>	<b>291,9</b>	<b>711,5</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	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%
<b>Total</b>	<b>6.96%</b>	<b>7.05%</b>	<b>6.95%</b>	<b>6.99%</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>	10	56	803	895	56	150	6645	8032	50	141	4338	5178
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	448	460	0	0	4680	2843	0	0	3383	1758
Otros <sup>c</sup>	56	10	290	186	150	56	1300	1724	141	50	532	1280
<b>Total</b>	<b>66</b>	<b>66</b>	<b>1541</b>	<b>1541</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>12625</b>	<b>12599</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>8253</b>	<b>8216</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.