

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de octubre de 2022**  
**Fecha de Información: 03 de octubre 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\$1923 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.03%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	276,6	281,3	183,1	194,4	53,7	37,8	44,4
15-35	534,8	622,8	316,1	221,8	39,4	45,6	267,3
36-60	159,3	138,0	35,7	42,3	41,3	56,0	61,0
61-90	12,5	10,8	7,6	7,0	3,2	5,5	0,0
91-180	78,3	74,6	37,0	45,0	22,6	18,3	15,0
>180	52,4	69,4	65,0	50,0	4,4	2,4	0,0
<b>Total</b>	<b>1113,8</b>	<b>1196,9</b>	<b>644,6</b>	<b>560,5</b>	<b>164,6</b>	<b>165,5</b>	<b>387,7</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	7.04%		7.05%	6.92%	6.99%
15-35	7.01%		7.01%	6.93%	6.99%
36-60	7.01%		7.12%	7.03%	7.05%
61-90	—		4.85%	6.95%	6.17%
91-180	7.07%		7.13%	6.92%	7.08%
>180	—		7.35%	7.49%	7.42%
<b>Total</b>	<b>7.01%</b>		<b>7.06%</b>	<b>7.00%</b>	<b>7.03%</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	03 - 07 oct.				10 - 14 oct.				17 - 21 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	57	151	6949	8246	52	142	4353	5246	17	143	3644	4283
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4814	3072	0	0	3432	1763	0	0	2024	865
Otros <sup>c</sup>	151	57	1339	1759	142	52	545	1284	143	17	479	977
<b>Total</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>13102</b>	<b>13077</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>8330</b>	<b>8293</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6147</b>	<b>6125</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.