

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de octubre de 2022**  
**Fecha de Información: 04 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\$3963 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.44%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	854,3	704,4	371,5	765,2	267,9	24,1	65,0
15-35	1097,8	1191,3	837,5	624,5	48,1	167,5	305,8
36-60	38,4	70,5	20,0	0,0	25,5	13,4	25,0
61-90	0,5	59,8	34,5	0,0	25,3	0,5	0,0
91-180	168,5	79,1	25,0	0,0	34,1	148,5	20,0
>180	73,5	51,1	20,0	60,0	21,1	3,5	10,0
<b>Total</b>	<b>2232,9</b>	<b>2156,2</b>	<b>1308,4</b>	<b>1449,6</b>	<b>421,9</b>	<b>357,4</b>	<b>425,8</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	6.84%		4.75%	6.33%	5.70%
15-35	6.84%		6.82%	6.85%	6.83%
36-60	6.89%		7.04%	6.70%	6.93%
61-90	-		7.13%	6.94%	7.13%
91-180	7.03%		7.22%	6.60%	6.75%
>180	7.03%		7.49%	7.16%	7.25%
<b>Total</b>	<b>6.86%</b>		<b>6.11%</b>	<b>6.61%</b>	<b>6.44%</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . 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>	50	108	6667	7329	53	144	4557	5813	17	143	3673	4455
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4338	3235	0	0	3687	1877	0	0	2168	868
Otros <sup>c</sup>	108	50	1195	1614	144	53	781	1293	143	17	493	990
<b>Total</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>12200</b>	<b>12178</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>9025</b>	<b>8983</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6334</b>	<b>6313</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.