

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de octubre de 2022**  
**Fecha de Información: 05 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\$3520 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.57%<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	739,1	1006,3	295,1	326,9	382,2	83,3	329,0
15-35	927,0	1099,4	576,8	288,3	57,7	173,7	465,0
36-60	8,5	14,1	0,0	0,0	8,4	2,8	5,7
61-90	58,3	76,0	30,0	10,0	6,0	8,3	40,0
91-180	289,5	36,2	2,0	61,7	34,2	227,8	0,0
>180	71,7	83,5	32,0	20,0	1,5	1,7	50,0
<b>Total</b>	<b>2094,1</b>	<b>2315,5</b>	<b>935,8</b>	<b>706,9</b>	<b>490,0</b>	<b>497,6</b>	<b>889,7</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	6.92%		5.09%	6.74%	6.13%
15-35	6.79%		6.96%	6.81%	6.87%
36-60	6.70%		6.84%	6.48%	6.73%
61-90	6.92%		6.85%	6.89%	6.91%
91-180	—		7.16%	6.82%	6.86%
>180	7.12%		7.33%	7.17%	7.14%
<b>Total</b>	<b>6.86%</b>		<b>6.15%</b>	<b>6.79%</b>	<b>6.57%</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1)$ . 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>	52	94	5611	6011	56	144	4863	6476	17	143	3739	4575
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3704	2812	0	0	3852	2014	0	0	2253	900
Otros <sup>c</sup>	94	52	537	1007	144	56	1156	1339	143	17	498	993
<b>Total</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>9852</b>	<b>9830</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>9871</b>	<b>9829</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6490</b>	<b>6468</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.