

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2022**  
**Fecha de Información: 11 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\$3926 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.87%<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	599,2	640,7	176,7	483,9	395,6	46,8	68,5
15-35	668,0	929,3	651,7	392,4	20,7	18,6	257,0
36-60	238,8	120,9	80,0	35,6	30,9	193,2	10,0
61-90	10,2	15,6	1,3	5,2	14,3	5,0	0,0
91-180	472,7	146,5	35,0	201,8	31,5	190,9	80,0
>180	108,9	455,6	384,0	40,4	6,6	3,5	65,0
<b>Total</b>	<b>2097,9</b>	<b>2308,7</b>	<b>1328,6</b>	<b>1159,2</b>	<b>499,6</b>	<b>458,1</b>	<b>480,5</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	7.24%		6.10%	6.73%	6.46%
15-35	7.23%		7.21%	7.11%	7.20%
36-60	7.07%		7.07%	7.03%	7.04%
61-90	—		7.19%	7.09%	7.17%
91-180	7.10%		7.07%	6.88%	6.96%
>180	7.22%		6.53%	7.29%	7.09%
<b>Total</b>	<b>7.20%</b>		<b>6.72%</b>	<b>6.89%</b>	<b>6.87%</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	10 – 14 oct.				17 - 21 oct.				24 - 28 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	67	141	6247	6931	23	143	4266	5395	25	179	6198	6044
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4038	3161	0	0	2518	1231	0	0	3465	2945
Otros <sup>c</sup>	141	67	1292	1440	143	23	959	1096	179	25	782	1416
<b>Total</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>11577</b>	<b>11532</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>7743</b>	<b>7722</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>10445</b>	<b>10405</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.