

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2022
Fecha de Información: 21 de octubre de 2022¹

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\$3212 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.41%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	741,4	204,6	109,2	635,4	32,4	43,0	63
15-35	759,5	912,2	635,4	498,6	42,7	0,0	261
36-60	71,3	42,4	6,0	16,1	36,4	55,2	0
61-90	111,0	71,6	10,0	70,0	26,6	6,0	35
91-180	57,2	466,5	403,3	10,0	43,2	27,2	20
>180	74,5	78,7	75,0	70,0	3,7	4,5	0
Total	1815,0	1776,1	1238,9	1300,0	185,1	136,0	379

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c 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 ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.31%	7.98%	7.57%	7.63%
15-35	7.34%	7.17%	7.17%	7.21%
36-60	—	7.45%	7.06%	7.20%
61-90	7.58%	7.48%	7.46%	7.50%
91-180	7.63%	7.59%	7.23%	7.55%
>180	—	8.18%	7.85%	8.02%
Total	7.37%	7.44%	7.40%	7.41%

^a 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.

¹A 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.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{365}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	17 – 21 oct.				24 - 28 oct.				31 oct. - 04 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	11	40	892	939	50	198	7440	8110	49	117	5556	5722
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	433	379	0	0	4239	3722	0	0	3658	2154
Otros ^c	40	11	110	118	198	50	1848	1648	117	49	399	1691
Total	51	51	1435	1436	248	248	13527	13480	166	166	9613	9567

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.