

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2022**  
**Fecha de Información: 24 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\$3016 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.35%<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	268,3	406,0	253,0	136,8	118,5	97,0	34,5
15-35	601,8	1087,9	753,1	346,0	107,0	28,1	227,7
36-60	212,0	113,1	0,0	129,2	47,1	16,8	66,0
61-90	5,0	7,0	0,0	0,0	7,0	5,0	0,0
91-180	312,9	110,4	24,6	225,0	35,8	37,9	50,0
>180	242,6	27,5	20,0	235,0	7,5	7,6	0,0
<b>Total</b>	<b>1642,6</b>	<b>1752,0</b>	<b>1050,7</b>	<b>1071,9</b>	<b>323,0</b>	<b>192,4</b>	<b>378,2</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	7.26%		7.12%	7.75%	7.40%
15-35	7.28%		7.29%	7.23%	7.27%
36-60	7.33%		7.35%	7.14%	7.29%
61-90	—		7.21%	7.32%	7.25%
91-180	7.65%		7.69%	7.46%	7.60%
>180	—		8.06%	7.98%	8.03%
<b>Total</b>	<b>7.33%</b>		<b>7.28%</b>	<b>7.45%</b>	<b>7.35%</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	24 – 28 oct.				31 oct. - 04 nov.				07 - 11 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	57	197	7665	8273	54	118	5573	5957	19	168	4498	5577
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4345	3855	0	0	3786	2158	0	0	4085	2032
Otros <sup>c</sup>	197	57	1887	1721	118	54	507	1703	168	19	294	1156
<b>Total</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>13897</b>	<b>13849</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>9866</b>	<b>9818</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>8877</b>	<b>8765</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.