INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2022
Fecha de Información: 18 de octubre de 2022[1]

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$5133 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	564,6	921,0	356,4	475,3	544,8	69,5	19,8
15-35	1213,6	922,0	830,6	884,3	42,8	280,7	48,6
36-60	343,5	341,5	310,0	50,0	26,5	288,5	5,0
61-90	7,1	61,9	55,2	5,0	6,7	2,1	0,0
91-180	357,7	437,9	410,0	122,9	27,9	234,8	0,0
>180	14,5	20,7	15,0	12,5	5,7	2,0	0,0
Total	**2501,1**	**2704,9**	**1977,2**	**1550,0**	**654,4**	**877,7**	**73,4**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	7.12%	5.36%	6.95%	5.92%
15-35	6.96%	7.08%	6.94%	7.01%
36-60	7.06%	7.09%	6.91%	6.94%
61-90	–	3.41%	6.84%	4.23%
91-180	–	7.14%	6.76%	6.83%
>180	–	7.22%	7.19%	7.21%
Total	**7.01%**	**6.19%**	**6.91%**	**6.55%**

[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.

[1] 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.

[2] 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

	17 – 21 oct.				24 - 28 oct.				31 oct. - 04 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	37	161	5580	6282	42	181	6473	7283	46	115	5352	5509
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2826	2283	0	0	3973	3000	0	0	3533	2069
Otros[c]	161	37	1426	1245	181	42	1411	1528	115	46	367	1638
Total	**198**	**198**	**9832**	**9810**	**223**	**223**	**11857**	**11811**	**161**	**161**	**9252**	**9216**

[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.