INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2022
Fecha de Información: 20 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$2422 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.96%[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	347,1	318,7	206,1	203,8	77,1	107,8	35,5
15-35	668,3	691,6	466,6	467,2	39,4	15,4	185,6
36-60	67,7	35,8	12,0	66,5	23,8	1,2	0,0
61-90	22,0	75,8	60,2	10,0	15,6	12,0	0,0
91-180	133,1	89,0	60,8	0,0	28,2	133,1	0,0
>180	60,6	163,3	130,2	10,0	3,1	20,6	30,0
Total	**1298,8**	**1374,2**	**935,9**	**757,5**	**187,2**	**290,2**	**251,1**

[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	7.14%	5.70%	6.81%	6.30%
15-35	7.14%	7.22%	7.09%	7.15%
36-60	–	7.23%	6.67%	7.20%
61-90	–	7.38%	7.10%	7.22%
91-180	–	7.17%	7.05%	7.09%
>180	7.57%	7.51%	7.23%	7.49%
Total	**7.19%**	**6.84%**	**7.01%**	**6.96%**

[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]	22	83	3207	3404	46	188	6864	7954	46	116	5410	5657
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1500	1452	0	0	4129	3191	0	0	3646	2077
Otros[c]	83	22	584	422	188	46	1838	1641	116	46	382	1662
Total	**105**	**105**	**5291**	**5278**	**234**	**234**	**12831**	**12786**	**162**	**162**	**9438**	**9396**

[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.