

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de octubre de 2022
Fecha de Información: 04 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\$3963 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.44%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	854,3	704,4	371,5	765,2	267,9	24,1	65,0
15-35	1097,8	1191,3	837,5	624,5	48,1	167,5	305,8
36-60	38,4	70,5	20,0	0,0	25,5	13,4	25,0
61-90	0,5	59,8	34,5	0,0	25,3	0,5	0,0
91-180	168,5	79,1	25,0	0,0	34,1	148,5	20,0
>180	73,5	51,1	20,0	60,0	21,1	3,5	10,0
Total	2232,9	2156,2	1308,4	1449,6	421,9	357,4	425,8

^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	6.84%	4.75%	6.33%	5.70%
15-35	6.84%	6.82%	6.85%	6.83%
36-60	6.89%	7.04%	6.70%	6.93%
61-90	—	7.13%	6.94%	7.13%
91-180	7.03%	7.22%	6.60%	6.75%
>180	7.03%	7.49%	7.16%	7.25%
Total	6.86%	6.11%	6.61%	6.44%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	03 – 07 oct.				10 - 14 oct.				17 - 21 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	50	108	6667	7329	53	144	4557	5813	17	143	3673	4455
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4338	3235	0	0	3687	1877	0	0	2168	868
Otros ^c	108	50	1195	1614	144	53	781	1293	143	17	493	990
Total	158	158	12200	12178	197	197	9025	8983	160	160	6334	6313

^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.