

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2022
Fecha de Información: 07 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\$2231 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.99%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	474,3	281,8	130,0	307,6	78,2	93,2	73,5
15-35	418,0	737,8	568,8	246,9	65,1	67,2	103,9
36-60	26,1	10,5	0,0	0,0	10,5	26,1	0,0
61-90	115,0	109,8	60,7	70,9	9,1	4,1	40,0
91-180	36,5	54,2	25,0	0,0	9,2	16,5	20,0
>180	129,2	79,8	70,0	95,0	4,8	29,2	5,0
Total	1199,2	1273,9	854,5	720,4	177,0	236,4	242,4

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	7.03%		6.99%	6.72%	6.86%
15-35	7.04%		7.04%	6.95%	7.02%
36-60	—		7.10%	6.73%	6.83%
61-90	7.09%		7.02%	7.05%	7.06%
91-180	7.04%		7.01%	6.65%	6.93%
>180	7.08%		7.30%	7.19%	7.23%
Total	7.05%		7.05%	6.89%	6.99%

^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	21	49	1009	1065	64	140	5372	6755	21	143	3883	4809
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	728	574	0	0	3930	2365	0	0	2426	930
Otros ^c	49	21	117	215	140	64	1283	1418	143	21	514	1061
Total	70	70	1854	1854	204	204	10585	10538	164	164	6823	6800

^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.