

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2022
Fecha de Información: 11 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\$3926 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.87%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	599,2	640,7	176,7	483,9	395,6	46,8	68,5
15-35	668,0	929,3	651,7	392,4	20,7	18,6	257,0
36-60	238,8	120,9	80,0	35,6	30,9	193,2	10,0
61-90	10,2	15,6	1,3	5,2	14,3	5,0	0,0
91-180	472,7	146,5	35,0	201,8	31,5	190,9	80,0
>180	108,9	455,6	384,0	40,4	6,6	3,5	65,0
Total	2097,9	2308,7	1328,6	1159,2	499,6	458,1	480,5

^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	7.24%	6.10%	6.73%	6.46%
15-35	7.23%	7.21%	7.11%	7.20%
36-60	7.07%	7.07%	7.03%	7.04%
61-90	—	7.19%	7.09%	7.17%
91-180	7.10%	7.07%	6.88%	6.96%
>180	7.22%	6.53%	7.29%	7.09%
Total	7.20%	6.72%	6.89%	6.87%

^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	10 – 14 oct.				17 - 21 oct.				24 - 28 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	67	141	6247	6931	23	143	4266	5395	25	179	6198	6044
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4038	3161	0	0	2518	1231	0	0	3465	2945
Otros ^c	141	67	1292	1440	143	23	959	1096	179	25	782	1416
Total	208	208	11577	11532	166	166	7743	7722	204	204	10445	10405

^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.