

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2022
Fecha de Información: 13 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\$3789 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.17%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	291,3	614,7	242,8	240,2	361,9	41,1	10,0
15-35	807,7	841,3	707,8	637,8	35,0	71,4	98,5
36-60	118,6	24,0	1,5	50,1	22,5	68,4	0,0
61-90	198,8	270,9	242,0	169,5	18,9	19,3	10,0
91-180	286,0	354,3	267,0	0,0	52,3	251,0	35,0
>180	85,2	49,4	30,5	72,1	18,9	13,1	0,0
Total	1787,5	2154,6	1491,7	1169,8	509,5	464,2	153,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	7.03%		3.79%	6.83%	4.45%
15-35	7.10%		7.04%	7.11%	7.07%
36-60	—		7.24%	6.99%	7.05%
61-90	7.11%		7.28%	6.92%	7.16%
91-180	7.03%		7.07%	6.78%	6.85%
>180	—		7.61%	7.34%	7.52%
Total	7.08%		5.48%	6.91%	6.17%

^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	27	68	3455	3715	23	147	4674	6047	27	181	6265	6265
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2481	2173	0	0	2733	1521	0	0	3581	2955
Otros ^c	68	27	375	389	147	23	1313	1130	181	27	860	1446
Total	95	95	6311	6277	170	170	8720	8698	208	208	10706	10666

^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.