

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2022
Fecha de Información: 14 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\$2725 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.63%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	533,2	334,0	143,2	314,7	105,8	0,0	218,5
15-35	774,9	1191,4	832,6	517,1	0,0	62,8	195,0
36-60	89,4	15,7	0,5	13,6	15,1	75,7	0,0
61-90	4,2	41,9	24,5	0,0	17,4	4,2	0,0
91-180	14,8	42,0	8,5	10,0	33,5	4,8	0,0
>180	83,3	44,3	8,0	47,5	6,3	5,8	30,0
Total	1499,8	1669,2	1017,4	902,9	178,0	153,3	443,6

^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	7.07%		6.92%	4.84%	5.82%
15-35	7.02%		6.95%	7.01%	6.98%
36-60	—		7.21%	7.00%	7.04%
61-90	—		6.44%	6.93%	6.50%
91-180	—		7.19%	6.92%	7.16%
>180	7.29%		7.49%	7.25%	7.28%
Total	7.06%		6.95%	6.08%	6.63%

^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

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	13	39	1571	1261	35	160	4951	6175	33	181	6403	6493
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	768	1081	0	0	2769	1709	0	0	3722	2982
Otros ^c	39	13	143	136	160	35	1395	1209	181	33	873	1483
Total	52	52	2482	2478	195	195	9115	9093	214	214	10998	10958

^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.