

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2022
Fecha de Información: 19 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\$3030 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.65%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	427,5	550,6	89,5	301,0	378,6	44,1	82,5
15-35	527,4	747,9	586,1	390,5	0,0	57,7	79,3
36-60	186,2	7,0	0,0	1,0	7,0	185,2	0,0
61-90	63,0	62,5	54,4	53,1	8,0	9,9	0,0
91-180	281,2	153,0	98,0	60,5	35,0	200,7	20,0
>180	89,1	146,5	87,5	51,2	29,0	7,9	30,0
Total	1574,5	1667,5	915,5	857,3	457,6	505,4	211,8

^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	7.07%	5.14%	7.02%	5.90%
15-35	7.04%	6.89%	6.98%	6.94%
36-60	—	4.88%	6.79%	6.72%
61-90	—	7.12%	6.89%	6.92%
91-180	7.13%	7.21%	6.97%	7.05%
>180	7.69%	7.48%	7.30%	7.47%
Total	7.15%	6.27%	6.96%	6.65%

^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	17 – 21 oct.				24 - 28 oct.				31 oct. - 04 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	30	117	4115	4440	43	184	6749	7740	46	116	5373	5554
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2144	1762	0	0	3988	3176	0	0	3573	2075
Otros ^c	117	30	679	719	184	43	1775	1552	116	46	372	1653
Total	147	147	6938	6921	227	227	12512	12468	162	162	9318	9282

^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.