

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2022
Fecha de Información: 12 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\$3374 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.51%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	569,1	648,1	370,6	319,5	59,5	31,6	218
15-35	409,4	926,1	792,3	282,9	19,8	12,5	114
36-60	217,9	18,0	3,0	160,5	15,0	57,4	0
61-90	50,7	105,7	79,4	40,0	16,3	0,7	10
91-180	374,6	190,8	150,4	361,5	30,4	3,1	10
>180	141,0	79,5	70,0	135,0	4,5	1,0	5
Total	1762,7	1968,3	1465,7	1299,4	145,6	106,3	357

^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	6.95%		6.94%	5.90%	6.47%
15-35	9.74%		5.93%	7.03%	6.49%
36-60	-		7.25%	6.95%	7.00%
61-90	7.09%		7.02%	6.27%	7.02%
91-180	7.00%		7.19%	6.13%	6.25%
>180	7.18%		7.52%	7.32%	7.39%
Total	7.85%		6.25%	6.25%	6.51%

^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.

¹A 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.

²El 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	37	97	4738	5016	23	143	4525	5698	26	179	6240	6103
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3164	2715	0	0	2683	1390	0	0	3497	2955
Otros ^c	97	37	557	684	143	23	1015	1112	179	26	792	1431
Total	134	134	8459	8415	166	166	8223	8200	205	205	10529	10489

^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.