INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2022
Fecha de Información: 06 de octubre de 2022[1]

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$2790 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.80%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	365,3	364,9	239,3	263,9	75,6	51,4	50,0
15-35	791,7	1117,7	781,2	338,1	17,5	134,6	319,0
36-60	83,6	25,7	21,5	3,7	2,3	78,0	1,9
61-90	42,9	26,1	15,0	30,2	11,1	12,8	0,0
91-180	27,8	89,0	40,0	10,4	34,0	2,4	15,0
>180	163,1	78,1	76,9	140,4	1,1	22,7	0,0
Total	**1474,5**	**1701,5**	**1174,0**	**786,7**	**141,6**	**301,9**	**385,9**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.93%	6.87%	6.35%	6.64%
15-35	6.90%	6.86%	6.75%	6.84%
36-60	6.66%	7.15%	6.72%	6.73%
61-90	–	7.07%	6.71%	6.87%
91-180	7.03%	6.21%	6.63%	6.47%
>180	–	7.15%	7.10%	7.12%
Total	**6.90%**	**6.86%**	**6.68%**	**6.80%**

[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

	03 – 07 oct.				10 - 14 oct.				17 - 21 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	34	72	3498	3963	59	143	5113	6596	20	143	3769	4690
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2637	1907	0	0	3885	2184	0	0	2342	900
Otros[c]	72	34	266	515	143	59	1215	1390	143	20	504	1003
Total	**106**	**106**	**6401**	**6385**	**202**	**202**	**10213**	**10170**	**163**	**163**	**6615**	**6593**

[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.