

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2022
Fecha de Información: 25 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\$3790 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.02%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	401,5	512,6	321,5	291,5	118,7	37,5	72,5
15-35	798,4	918,6	499,3	384,8	49,8	0,0	413,6
36-60	147,5	499,1	461,4	102,9	22,8	29,6	15,0
61-90	2,0	7,0	0,0	0,0	7,0	2,0	0,0
91-180	450,1	48,1	0,9	334,5	37,2	105,6	10,0
>180	462,7	83,6	38,0	430,7	15,6	2,0	30,0
Total	2262,3	2069,1	1321,0	1544,4	251,1	176,7	541,1

^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	7.10%	6.42%	6.72%	6.58%
15-35	7.17%	7.32%	7.12%	7.17%
36-60	7.19%	7.39%	7.18%	7.21%
61-90	—	7.73%	7.26%	7.63%
91-180	7.54%	7.61%	7.34%	7.42%
>180	7.73%	7.82%	7.75%	7.78%
Total	7.20%	6.83%	7.07%	7.02%

^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	24 – 28 oct.				31 oct. - 04 nov.				07 - 11 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	49	152	6269	6448	55	121	5703	6392	20	169	4631	5599
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3250	2965	0	0	4061	2226	0	0	4089	2144
Otros ^c	152	49	1697	1766	121	55	615	1713	169	20	296	1161
Total	201	201	11216	11179	176	176	10379	10331	189	189	9016	8904

^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.