

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2022
Fecha de Información: 26 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\$3873 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.76%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	992,3	528,9	168,2	921,3	310,5	20,8	50,2
15-35	751,3	510,0	252,5	513,1	50,7	0,0	238,3
36-60	58,6	96,2	30,0	0,7	26,2	17,9	40,0
61-90	40,2	36,1	0,4	0,0	25,7	30,2	10,0
91-180	368,8	311,6	250,0	30,0	41,6	318,8	20,0
>180	34,4	532,8	498,2	3,6	4,6	0,8	30,0
Total	2245,6	2015,6	1199,2	1468,6	459,4	388,6	388,5

^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	6.94%	2.51%	5.55%	3.87%
15-35	6.82%	6.94%	6.76%	6.86%
36-60	6.90%	6.66%	6.89%	6.82%
61-90	7.33%	7.37%	7.09%	7.24%
91-180	7.23%	7.62%	7.00%	7.07%
>180	7.58%	7.98%	3.81%	7.55%
Total	6.95%	4.54%	6.46%	5.76%

^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	38	132	4633	4540	56	131	6248	6793	21	171	4765	5695
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2623	2486	0	0	4162	2752	0	0	4139	2235
Otros ^c	132	38	700	899	131	56	899	1717	171	21	306	1168
Total	170	170	7956	7925	187	187	11309	11262	192	192	9210	9098

^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.