

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2022
Fecha de Información: 27 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\$5003 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.57%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	659,8	391,6	228,2	494,1	119,9	122,1	43,5
15-35	1011,2	764,6	364,4	759,6	200,9	0,0	251,6
36-60	136,5	49,9	1,7	7,3	28,3	109,1	20,0
61-90	171,2	1320,6	1141,5	30,0	39,0	1,2	140,0
91-180	9,8	76,4	14,2	8,6	62,2	1,2	0,0
>180	858,9	60,0	0,0	801,0	8,0	5,9	52,0
Total	2847,3	2663,0	1750,0	2100,6	458,3	239,6	507,1

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.87%		6.97%	5.28%	5.98%
15-35	6.84%		6.59%	6.73%	6.69%
36-60	6.91%		7.14%	6.89%	6.94%
61-90	7.12%		7.08%	7.35%	7.13%
91-180	—		7.39%	7.23%	7.38%
>180	7.64%		7.95%	7.93%	7.76%
Total	7.03%		6.85%	6.12%	6.57%

^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	28	104	3327	3155	58	143	6520	7002	22	176	5022	5817
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1877	1775	0	0	4270	2967	0	0	4197	2453
Otros ^c	104	28	560	817	143	58	970	1744	176	22	335	1172
Total	132	132	5764	5747	201	201	11760	11713	198	198	9554	9442

^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.