

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 28 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\$2295 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.10%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	328,8	420,4	125,4	118,5	198,5	113,8	96,5
15-35	500,8	562,1	257,6	299,0	154,0	51,3	150,5
36-60	48,2	31,1	12,0	25,3	19,1	22,8	0,0
61-90	56,2	63,9	15,0	0,0	28,9	36,2	20,0
91-180	263,6	101,1	0,0	25,0	79,1	216,6	22,0
>180	172,4	150,3	30,0	42,0	5,3	15,4	115,0
Total	1369,9	1328,8	440,0	509,9	484,8	456,0	404,0

^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	6.87%	3.12%	4.41%	4.13%
15-35	6.89%	6.81%	6.73%	6.80%
36-60	—	7.26%	6.65%	7.00%
61-90	7.06%	7.19%	6.93%	7.05%
91-180	7.22%	7.25%	6.84%	6.97%
>180	7.68%	7.65%	7.68%	7.67%
Total	7.14%	5.53%	6.19%	6.10%

^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	13	59	883	813	63	145	6710	7173	32	178	5178	6006
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	272	286	0	0	4377	3048	1	0	4202	2553
Otros ^c	59	13	359	415	145	63	985	1804	177	32	515	1211
Total	72	72	1514	1514	208	208	12072	12025	210	210	9895	9770

^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.