

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 31 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\$2774 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.36%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	569,1	316,2	163,7	395,8	73,0	93,9	79,5
15-35	709,2	743,6	373,9	389,2	154,7	105,0	215,0
36-60	124,3	232,4	179,0	76,8	18,4	12,4	35,0
61-90	7,4	18,5	0,0	0,0	18,5	7,4	0,0
91-180	238,2	95,8	20,0	164,0	25,8	24,2	50,0
>180	1,0	98,1	97,1	0,0	1,0	1,0	0,0
Total	1649,2	1504,5	833,7	1025,8	291,3	243,9	379,5

^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	6.76%	6.70%	5.81%	6.13%
15-35	6.72%	6.69%	6.70%	6.70%
36-60	6.89%	5.19%	7.03%	5.53%
61-90	—	7.31%	7.00%	7.22%
91-180	7.08%	7.38%	5.91%	6.31%
>180	—	7.97%	7.41%	7.68%
Total	6.79%	6.38%	6.17%	6.36%

^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	31 oct. - 04 nov.				07 - 11 nov.				14 - 18 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	67	147	7132	7321	39	178	5342	6164	36	155	5610	4797
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4439	3354	1	0	4303	2671	0	0	3177	2850
Otros ^c	147	67	1038	1878	177	39	534	1221	155	36	829	1941
Total	214	214	12609	12553	217	217	10179	10056	191	191	9616	9588

^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.