

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 04 de noviembre 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\$3244 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.03%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	738,9	664,0	266,9	506,0	204,7	40,6	192,3
15-35	727,1	956,6	440,2	242,5	69,0	37,3	447,3
36-60	4,2	100,2	91,0	2,7	9,2	1,5	0,0
61-90	10,5	80,8	75,0	0,0	5,8	10,5	0,0
91-180	341,3	273,0	140,0	40,0	21,0	189,3	112,0
>180	76,2	34,3	20,0	60,0	3,3	5,2	11,0
Total	1898,2	2108,9	1033,2	851,2	313,1	284,4	762,6

^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	6.41%		3.41%	5.26%	4.68%
15-35	6.68%		6.77%	6.57%	6.69%
36-60	—		6.77%	6.49%	6.77%
61-90	—		7.06%	6.95%	7.04%
91-180	7.42%		7.22%	6.92%	7.13%
>180	7.52%		8.20%	7.64%	7.65%
Total	6.74%		5.50%	6.12%	6.03%

^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.

¹A 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.

²El 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	9	51	651	780	51	181	6188	6959	44	156	6107	5684
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	566	273	1	0	4438	3265	0	0	3612	3071
Otros ^c	51	9	54	208	180	51	999	1278	156	44	1092	2029
Total	60	60	1271	1261	232	232	11625	11502	200	200	10811	10784

^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.