

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 08 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\$4278 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.56%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	1055,4	729,7	115,0	713,8	357,0	83,8	257,7
15-35	1162,0	1329,2	720,0	553,6	64,3	63,5	545,0
36-60	85,2	167,2	0,0	15,8	112,2	14,4	55,0
61-90	160,9	64,1	32,3	0,0	31,8	160,8	0,0
91-180	188,9	158,2	80,0	0,0	28,2	138,9	50,0
>180	69,1	72,1	12,5	10,0	3,5	3,1	56,0
Total	2721,5	2520,6	959,8	1293,3	597,1	464,6	963,7

^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	6.82%	4.62%	6.76%	6.07%
15-35	6.79%	6.67%	6.65%	6.70%
36-60	7.00%	7.00%	6.70%	6.97%
61-90	—	6.67%	7.00%	6.94%
91-180	7.48%	7.42%	6.95%	7.19%
>180	7.83%	8.18%	7.47%	7.85%
Total	6.91%	6.08%	6.78%	6.56%

^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	07 – 11 nov.				14 - 18 nov.				21 - 25 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	52	158	6961	7114	47	160	6486	6274	10	157	5625	5614
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4447	3885	0	0	3708	3185	0	0	3772	2830
Otros ^c	157	52	1052	1336	160	47	1394	2097	157	10	447	1365
Total	210	210	12460	12335	207	207	11588	11556	167	167	9844	9809

^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.