

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 |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 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.

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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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.