

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 01 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\$2231 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.01%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	576,3	540,8	119,3	483,0	355,9	27,8	65,5
15-35	332,4	699,9	515,9	183,7	0,0	31,1	117,6
36-60	42,6	19,1	14,9	26,6	2,2	14,0	2,0
61-90	0,9	12,1	3,0	0,0	9,1	0,9	0,0
91-180	151,7	32,3	15,0	0,0	17,3	151,7	0,0
>180	6,6	1,5	0,0	0,0	1,5	6,6	0,0
Total	1110,5	1305,7	668,1	693,4	386,1	232,0	185,1

^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	6.71%		4.78%	5.50%	5.24%
15-35	6.68%		6.81%	6.56%	6.73%
36-60	6.77%		6.85%	6.70%	6.77%
61-90	-		7.27%	6.56%	7.20%
91-180	-		7.22%	6.86%	6.92%
>180	-		7.89%	7.15%	7.29%
Total	6.69%		5.82%	6.05%	6.01%

^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	50	114	6253	6304	44	178	5477	6606	37	154	5786	4975
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3810	2898	1	0	4385	2775	0	0	3295	2956
Otros ^c	114	50	815	1619	177	44	881	1239	154	37	833	1956
Total	164	164	10878	10821	222	222	10743	10620	191	191	9914	9887

^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.