

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 02 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\$2969 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.63%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	610,4	462,6	226,4	482,3	146,3	38,2	89,9
15-35	780,3	897,3	517,2	354,0	0,0	83,8	342,5
36-60	145,1	104,6	37,0	74,6	14,6	17,5	53,0
61-90	37,7	14,8	0,0	26,0	14,8	11,7	0,0
91-180	198,1	198,2	125,0	25,0	11,2	111,1	62,0
>180	49,8	54,4	10,0	12,3	7,4	0,5	37,0
Total	1821,3	1732,0	915,6	974,2	194,3	262,7	584,4

^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	6.77%		6.08%	6.45%	6.33%
15-35	6.72%		6.81%	6.47%	6.66%
36-60	6.87%		6.11%	6.67%	6.58%
61-90	-		7.14%	6.94%	6.99%
91-180	7.31%		7.20%	6.93%	7.11%
>180	7.55%		7.63%	7.68%	7.59%
Total	6.85%		6.57%	6.56%	6.63%

^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	42	96	5113	4977	46	179	5593	6774	38	154	5813	5038
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3073	2624	1	0	4399	2839	0	0	3314	2958
Otros ^c	96	42	382	928	178	46	989	1245	154	38	877	1981
Total	138	138	8568	8529	225	225	10981	10858	192	192	10004	9977

^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.