

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 03 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\$2835 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.54%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	295,6	227,2	139,7	171,5	20,6	57,1	67,0
15-35	652,5	1220,4	800,8	303,2	0,0	35,0	314,2
36-60	6,3	33,2	28,0	1,0	5,2	5,4	0,0
61-90	7,4	9,1	0,0	0,0	9,1	7,4	0,0
91-180	222,4	73,0	35,0	192,0	18,0	10,4	20,0
>180	386,4	163,9	99,2	321,6	3,2	3,2	61,5
Total	1570,6	1726,9	1102,7	989,4	56,1	118,5	462,7

^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	7.04%		6.46%	5.60%	6.10%
15-35	6.62%		6.43%	6.58%	6.54%
36-60	-		6.77%	6.50%	6.73%
61-90	-		7.15%	6.66%	6.93%
91-180	7.32%		7.32%	7.12%	7.27%
>180	7.33%		6.70%	7.20%	6.99%
Total	6.81%		6.57%	6.27%	6.54%

^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	29	74	3696	3733	48	180	5775	6860	38	155	5954	5196
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2378	1829	1	0	4415	2940	0	0	3422	3034
Otros ^c	74	29	184	666	179	48	993	1260	155	38	897	2015
Total	103	103	6258	6228	228	228	11183	11060	193	193	10273	10245

^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.