

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 15 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\$3781 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.74%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	726,7	1046,9	169,7	436,9	658,2	70,7	219,0
15-35	700,9	1015,4	640,6	286,7	36,6	0,0	414,2
36-60	43,5	36,0	0,0	30,5	36,0	13,0	0,0
61-90	365,7	31,4	0,0	1,0	31,4	364,7	0,0
91-180	302,2	117,4	14,7	2,1	62,7	260,1	40,0
>180	52,4	36,2	10,0	30,0	6,2	2,4	20,0
Total	2191,3	2283,2	835,0	787,3	831,1	710,9	693,2

^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	6.55%	6.87%	6.56%	6.72%
15-35	6.53%	6.68%	5.97%	6.51%
36-60	—	7.03%	6.84%	6.98%
61-90	—	7.16%	6.84%	6.87%
91-180	7.08%	7.39%	7.16%	7.19%
>180	7.34%	7.70%	7.53%	7.48%
Total	6.60%	6.83%	6.70%	6.74%

^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	14 – 18 nov.				21 - 25 nov.				28 nov. - 02 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	62	185	7543	7516	13	184	5943	6786	22	219	4799	4855
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4073	3763	2	0	4184	3032	0	0	2771	2060
Otros ^c	185	62	1958	2241	182	13	1156	1413	219	22	796	1406
Total	247	247	13574	13520	197	197	11283	11231	241	241	8366	8321

^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.