

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 21 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\$4845 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.45%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	1757,4	1244,9	685,0	1447,1	283,9	34,3	276,0
15-35	286,3	776,0	715,0	211,7	26,0	39,6	35,0
36-60	75,1	22,6	0,3	54,0	13,6	12,3	8,8
61-90	313,3	54,7	0,0	35,0	4,7	228,3	50,0
91-180	109,2	643,2	538,1	31,5	35,1	7,7	70,0
>180	0,1	1,7	0,0	0,0	1,7	0,1	0,0
Total	2541,4	2743,0	1938,3	1779,3	364,9	322,3	439,7

^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	6.52%	6.24%	6.06%	6.22%
15-35	6.56%	6.50%	6.44%	6.49%
36-60	6.79%	7.10%	6.69%	6.79%
61-90	6.85%	7.19%	6.83%	6.84%
91-180	7.24%	7.32%	7.22%	7.27%
>180	—	7.59%	7.38%	7.58%
Total	6.68%	6.46%	6.35%	6.45%

^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	21 – 25 nov.				28 nov. - 02 dic.				05 - 09 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	22	190	8132	8519	25	223	5724	6306	11	174	4221	4342
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	4825	4967	0	0	3488	2543	0	0	2352	1558
Otros ^c	188	22	2081	1494	223	25	1189	1508	174	11	585	1186
Total	212	212	15038	14980	248	248	10401	10357	185	185	7158	7086

^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.