

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 22 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\$3219 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.53%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	699,4	886,1	226,6	488,0	484,5	36,4	175,0
15-35	664,5	933,8	553,4	289,9	19,1	13,3	361,3
36-60	41,8	22,8	0,0	20,7	12,8	11,1	10,0
61-90	286,5	63,1	0,0	10,0	38,1	251,5	25,0
91-180	70,1	161,7	70,0	0,0	38,7	17,1	53,0
>180	5,3	8,4	0,0	0,0	8,4	5,3	0,0
Total	1767,6	2075,9	850,0	808,6	601,6	334,7	624,2

^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	6.53%	6.53%	6.25%	6.43%
15-35	6.50%	6.40%	6.51%	6.45%
36-60	6.76%	6.89%	6.22%	6.63%
61-90	6.77%	7.10%	6.69%	6.74%
91-180	7.26%	7.20%	7.25%	7.23%
>180	—	7.63%	7.38%	7.54%
Total	6.59%	6.56%	6.46%	6.53%

^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	162	7866	8121	26	224	5840	6858	11	174	4380	4492
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	4676	4806	0	0	3522	2559	0	0	2371	1616
Otros ^c	160	22	1901	1466	224	26	1637	1537	174	11	615	1187
Total	184	184	14443	14393	250	250	10999	10954	185	185	7366	7295

^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.