

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 23 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\$3649 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.52%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	534,3	905,3	85,4	141,5	508,8	81,6	311,2
15-35	813,4	588,1	241,8	455,4	39,8	51,4	306,5
36-60	229,9	81,6	47,0	0,0	17,8	213,1	16,8
61-90	486,5	101,0	38,0	255,0	24,5	0,0	231,5
91-180	167,1	96,4	1,1	67,0	35,3	40,1	60,0
>180	86,4	485,0	482,0	72,0	3,0	14,4	0,0
Total	2317,6	2257,4	895,3	990,9	629,2	400,6	926,0

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.71%		6.67%	4.54%	6.25%
15-35	6.68%		6.17%	6.58%	6.51%
36-60	6.77%		6.82%	6.74%	6.76%
61-90	6.87%		7.08%	6.70%	6.80%
91-180	7.18%		7.38%	7.11%	7.18%
>180	—		7.78%	7.49%	7.54%
Total	6.74%		6.64%	6.23%	6.52%

^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	17	130	4246	4493	26	228	6188	7539	12	176	4511	4674
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	2394	2298	0	0	3537	2649	0	0	2408	1698
Otros ^c	128	17	1302	1124	228	26	2049	1542	176	12	717	1193
Total	147	147	7942	7915	254	254	11774	11730	188	188	7636	7565

^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.