

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 25 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\$2610 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.48%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	306,4	476,8	37,0	108,8	270,8	28,6	169,0
15-35	600,5	652,0	231,7	183,6	42,2	38,9	378,0
36-60	76,3	21,6	0,0	1,1	21,6	75,3	0,0
61-90	425,8	32,1	0,0	414,3	22,1	1,5	10,0
91-180	120,5	314,5	203,1	5,0	21,4	25,5	90,0
>180	4,6	230,6	223,1	0,0	2,9	0,0	4,6
Total	1534,2	1727,5	694,9	712,7	381,0	169,9	651,6

^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	6.69%	6.59%	4.52%	6.31%
15-35	6.68%	5.68%	6.44%	6.37%
36-60	—	6.96%	6.73%	6.78%
61-90	6.88%	7.22%	6.85%	7.10%
91-180	7.30%	7.49%	7.13%	7.29%
>180	7.62%	7.72%	—	7.66%
Total	6.78%	6.37%	6.07%	6.48%

^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	12	53	671	741	29	230	6587	8064	13	177	4610	4707
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	230	231	0	0	3654	2891	0	0	2409	1760
Otros ^c	53	12	375	304	230	29	2314	1556	177	13	724	1206
Total	65	65	1276	1276	259	259	12555	12511	190	190	7743	7673

^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.