

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 28 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\$6820 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.31%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	1071,9	740,4	258,4	829,8	337,5	97,7	144,5
15-35	1606,5	1222,6	657,0	1077,1	59,6	23,4	506,0
36-60	317,9	1309,1	1180,0	120,0	45,7	114,5	83,4
61-90	376,7	41,1	5,0	280,0	16,1	76,7	20,0
91-180	461,2	326,7	5,2	53,5	33,5	119,7	288,0
>180	241,9	270,2	140,0	116,0	6,2	1,9	124,0
Total	4076,2	3910,0	2245,6	2476,4	498,5	433,9	1165,9

^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	6.87%	6.05%	5.60%	5.93%
15-35	6.67%	6.64%	5.47%	6.18%
36-60	6.71%	5.99%	6.79%	6.29%
61-90	7.10%	7.19%	6.76%	6.89%
91-180	7.13%	7.37%	7.01%	7.12%
>180	7.65%	7.64%	7.64%	7.65%
Total	6.93%	6.28%	5.91%	6.31%

^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	28 nov. - 02 dic.				05 - 09 dic.				12 - 16 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	32	220	7358	8459	17	183	4743	5018	41	175	6243	7381
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3820	3458	0	0	2411	1820	0	0	4311	2794
Otros ^c	220	32	2414	1631	183	17	997	1243	175	41	568	618
Total	252	252	13592	13548	200	200	8151	8081	216	216	11122	10793

^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.