

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 29 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\$3987 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	700,1	699,0	196,4	485,5	353,8	65,8	148,7
15-35	477,5	987,4	724,1	270,4	109,5	53,4	153,8
36-60	66,6	62,7	25,8	0,0	36,9	66,6	0,0
61-90	173,4	174,2	99,0	10,0	55,2	143,4	20,0
91-180	342,5	205,1	69,6	65,0	53,5	195,5	82,0
>180	443,5	88,7	50,0	406,0	9,7	8,5	29,0
Total	2203,6	2217,0	1164,9	1236,9	618,6	533,2	433,5

^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	6.60%	6.01%	6.10%	6.12%
15-35	6.61%	6.66%	6.57%	6.62%
36-60	7.84%	6.89%	6.72%	6.78%
61-90	7.01%	6.91%	6.87%	6.90%
91-180	7.19%	7.28%	6.94%	7.07%
>180	7.52%	7.19%	7.42%	7.31%
Total	6.80%	6.49%	6.51%	6.55%

^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	26	180	6313	6820	18	185	4824	5544	46	179	6476	7506
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3114	2869	0	0	2553	1844	0	0	4380	2963
Otros ^c	180	26	1929	1629	185	18	1331	1250	179	46	597	655
Total	206	206	11356	11318	203	203	8708	8638	225	225	11453	11124

^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.