

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 30 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\$2738 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.54%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	509,7	434,6	172,4	445,6	0,0	28,6	35,5
15-35	489,7	553,2	289,8	330,7	149,9	45,5	113,5
36-60	65,0	172,8	125,0	5,0	44,3	0,0	60,0
61-90	124,8	126,8	45,0	15,0	40,8	68,8	41,0
91-180	243,9	91,8	0,0	12,6	51,8	191,3	40,0
>180	42,2	214,9	100,3	0,0	73,6	1,2	41,0
Total	1475,3	1594,1	732,5	808,9	360,4	335,4	331,0

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.85%	6.55%	6.60%	6.59%
15-35	6.03%	5.86%	6.46%	6.06%
36-60	6.70%	6.35%	6.68%	6.49%
61-90	6.98%	7.02%	6.70%	6.87%
91-180	6.83%	7.28%	6.85%	6.92%
>180	7.51%	7.61%	7.33%	7.57%
Total	6.62%	6.42%	6.64%	6.54%

^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	19	149	4046	4171	20	187	4965	5787	47	182	6512	7784
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2151	2258	0	0	2582	1952	0	0	4536	2963
Otros ^c	149	19	943	676	187	20	1532	1270	182	47	686	658
Total	168	168	7140	7105	207	207	9079	9009	229	229	11734	11405

^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.