

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 09 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\$5182 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.85%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	758,3	1148,5	514,9	500,2	411,1	35,6	222,5
15-35	1039,3	1527,2	889,0	533,5	162,1	29,8	476,1
36-60	11,2	72,1	13,9	0,0	48,2	1,2	10,0
61-90	174,6	52,5	0,0	70,0	52,5	104,6	0,0
91-180	288,8	208,7	40,0	50,0	61,7	131,8	107,0
>180	610,5	155,6	95,0	559,8	10,6	0,7	50,0
Total	2882,8	3164,5	1552,7	1713,5	746,1	303,7	865,6

^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	6.43%	6.14%	Inf%	6.42%
15-35	6.97%	6.78%	6.87%	6.86%
36-60	6.99%	6.56%	6.56%	6.63%
61-90	–	7.17%	6.93%	7.01%
91-180	7.45%	7.45%	7.30%	7.38%
>180	7.75%	7.90%	8.03%	7.92%
Total	6.94%	6.69%	6.97%	6.85%

^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.

¹A 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.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	07 – 11 nov.				14 - 18 nov.				21 - 25 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	45	138	6469	6672	49	172	6832	6784	11	165	5700	6077
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4171	3558	0	0	3752	3377	2	0	4180	2896
Otros ^c	137	45	967	1260	172	49	1741	2114	163	11	500	1369
Total	183	183	11607	11490	221	221	12325	12275	176	176	10380	10342

^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.