

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2022

Fecha de Información: 10 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\$3319 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.98%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	206,1	353,0	116,9	136,1	217,1	51,0	19,0
15-35	1041,9	1148,8	570,5	430,3	158,3	191,7	419,9
36-60	34,1	80,8	12,8	1,4	68,0	32,7	0,0
61-90	55,5	134,6	10,7	0,0	76,8	8,4	47,0
91-180	137,6	175,5	40,7	45,0	101,8	59,6	33,0
>180	380,4	99,7	75,0	355,4	14,7	15,0	10,0
Total	1855,7	1992,4	826,7	968,3	636,8	358,5	528,9

^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	6.92%		6.77%	5.48%	6.26%
15-35	7.03%		6.88%	6.79%	6.90%
36-60	-		6.94%	6.79%	6.90%
61-90	6.95%		7.17%	6.82%	7.07%
91-180	7.20%		7.29%	7.26%	7.27%
>180	7.53%		7.88%	7.83%	7.83%
Total	7.04%		6.98%	6.95%	6.98%

^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	26	92	1304	1192	51	182	6935	7097	12	177	5766	6110
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	603	480	0	0	3860	3429	2	0	4184	2932
Otros ^c	92	26	190	398	182	51	1939	2154	175	12	511	1379
Total	118	118	2097	2070	233	233	12734	12680	189	189	10461	10421

^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.