

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 11 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\$937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.25%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,2	90,1	61,2	0,9	23,9	15,3	5
15-35	300,6	264,8	204,4	249,9	15,4	5,7	45
36-60	46,2	8,6	2,7	42,0	5,8	4,2	0
61-90	120,4	94,2	30,0	68,0	14,2	2,4	50
91-180	41,9	61,6	20,0	20,0	21,6	1,9	20
>180	2,1	5,6	0,0	0,0	5,6	2,1	0
Total	532,4	524,8	318,3	380,8	86,5	31,6	120

^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%		6.80%	-5.22%	4.58%
15-35	6.25%		6.25%	6.24%	6.24%
36-60	-		8.14%	6.54%	6.73%
61-90	6.55%		7.06%	6.63%	6.64%
91-180	6.99%		7.30%	6.98%	7.09%
>180	-		8.09%	7.55%	7.94%
Total	6.53%		6.65%	5.83%	6.25%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	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	0	3	1	3	59	183	6947	7178	13	179	5767	6118
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	0	0	0	0	3921	3430	2	0	4184	2932
Otros ^c	3	0	3	1	183	59	1955	2160	177	13	518	1381
Total	3	3	4	4	242	242	12823	12768	192	192	10469	10431

^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.