INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 17 de noviembre de 2022[1]

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$3495 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.42%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	542,7	739,6	363,6	347,7	0,0	22,0	173
15-35	1047,8	647,5	310,5	726,9	0,0	0,0	321
36-60	2,3	4,4	0,1	0,0	4,3	2,3	0
61-90	255,5	21,6	10,0	53,0	6,6	197,5	5
91-180	169,4	502,7	422,9	38,0	24,8	76,4	55
>180	39,2	111,2	75,0	0,3	1,2	4,0	35
Total	**2057,0**	**2027,1**	**1182,1**	**1165,9**	**36,9**	**302,1**	**589**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.75%	6.55%	5.30%	6.14%
15-35	6.71%	6.47%	6.28%	6.44%
36-60	–	7.00%	6.03%	6.66%
61-90	6.79%	6.92%	6.76%	6.77%
91-180	7.11%	6.32%	7.04%	6.53%
>180	7.33%	7.35%	7.02%	7.33%
Total	**6.79%**	**6.49%**	**6.16%**	**6.42%**

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

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	14 – 18 nov.				21 - 25 nov.				28 nov. - 02 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	25	74	3943	4063	16	185	6532	7899	23	219	4972	5271
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2554	2174	2	0	4321	3431	0	0	3128	2132
Otros[c]	74	25	627	859	183	16	2011	1475	219	23	829	1482
Total	**99**	**99**	**7124**	**7096**	**201**	**201**	**12864**	**12805**	**242**	**242**	**8929**	**8885**

[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.