INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 18 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$1847 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.64%[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	346,1	283,2	58,8	263,0	162,4	21,0	62,0
15-35	318,7	470,8	279,4	131,5	31,4	27,2	160,0
36-60	25,7	4,2	0,0	0,0	4,2	25,7	0,0
61-90	63,7	38,9	25,3	0,0	13,6	63,7	0,0
91-180	213,9	193,1	70,0	20,0	33,1	103,9	90,0
>180	194,5	198,5	6,0	1,3	0,3	1,0	192,2
Total	**1162,6**	**1188,7**	**439,5**	**415,9**	**244,9**	**242,5**	**504,2**

[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	6.82%	5.84%	5.89%	5.98%
15-35	6.75%	6.71%	6.56%	6.68%
36-60	–	7.00%	6.75%	6.78%
61-90	–	7.10%	6.83%	6.88%
91-180	7.30%	6.78%	7.06%	7.03%
>180	7.61%	7.78%	7.28%	7.61%
Total	**7.18%**	**6.36%**	**6.41%**	**6.64%**

[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]	15	37	631	686	19	186	6742	8002	25	220	5203	5579
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	211	70	2	0	4330	3594	0	0	3225	2252
Otros[c]	37	15	172	252	184	19	2069	1487	220	25	934	1487
Total	**52**	**52**	**1014**	**1008**	**205**	**205**	**13141**	**13083**	**245**	**245**	**9362**	**9318**

[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.