INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 24 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$213 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.11%[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	4,0	8,1	5,3	0,0	1,8	3,0	1
15-35	16,2	8,5	0,0	9,1	7,5	6,2	1
36-60	0,6	90,8	64,0	0,0	26,8	0,6	0
61-90	0,3	3,1	0,0	0,0	3,1	0,3	0
91-180	65,0	6,9	0,0	64,0	6,9	1,0	0
>180	7,1	4,3	0,0	5,0	4,3	2,1	0
Total	**93,2**	**121,8**	**69,3**	**78,0**	**50,4**	**13,2**	**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	6.71%	7.02%	6.25%	6.71%
15-35	6.67%	6.95%	6.36%	6.57%
36-60	–	7.04%	5.61%	7.03%
61-90	–	7.29%	6.64%	7.24%
91-180	–	7.54%	7.34%	7.36%
>180	–	7.86%	7.56%	7.76%
Total	**6.69%**	**7.10%**	**7.13%**	**7.11%**

[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

	21 – 25 nov.				28 nov. - 02 dic.				05 - 09 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	12	54	606	750	26	229	6248	7589	12	176	4528	4693
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	237	213	0	0	3542	2663	0	0	2409	1698
Otros[c]	54	12	377	257	229	26	2050	1543	176	12	720	1195
Total	**66**	**66**	**1220**	**1220**	**255**	**255**	**11840**	**11795**	**188**	**188**	**7657**	**7586**

[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.