

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2022**  
**Fecha de Información: 15 de noviembre de 2022<sup>1</sup>**

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\$3781 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.74%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	726,7	1046,9	169,7	436,9	658,2	70,7	219,0
15-35	700,9	1015,4	640,6	286,7	36,6	0,0	414,2
36-60	43,5	36,0	0,0	30,5	36,0	13,0	0,0
61-90	365,7	31,4	0,0	1,0	31,4	364,7	0,0
91-180	302,2	117,4	14,7	2,1	62,7	260,1	40,0
>180	52,4	36,2	10,0	30,0	6,2	2,4	20,0
<b>Total</b>	<b>2191,3</b>	<b>2283,2</b>	<b>835,0</b>	<b>787,3</b>	<b>831,1</b>	<b>710,9</b>	<b>693,2</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.55%		6.87%	6.56%	6.72%
15-35	6.53%		6.68%	5.97%	6.51%
36-60	—		7.03%	6.84%	6.98%
61-90	—		7.16%	6.84%	6.87%
91-180	7.08%		7.39%	7.16%	7.19%
>180	7.34%		7.70%	7.53%	7.48%
<b>Total</b>	<b>6.60%</b>		<b>6.83%</b>	<b>6.70%</b>	<b>6.74%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	14 – 18 nov.				21 - 25 nov.				28 nov. - 02 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	62	185	7543	7516	13	184	5943	6786	22	219	4799	4855
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4073	3763	2	0	4184	3032	0	0	2771	2060
Otros <sup>c</sup>	185	62	1958	2241	182	13	1156	1413	219	22	796	1406
<b>Total</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>13574</b>	<b>13520</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>11283</b>	<b>11231</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>8366</b>	<b>8321</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.