

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2022**

**Fecha de Información: 23 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\$3649 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.52%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	534,3	905,3	85,4	141,5	508,8	81,6	311,2
15-35	813,4	588,1	241,8	455,4	39,8	51,4	306,5
36-60	229,9	81,6	47,0	0,0	17,8	213,1	16,8
61-90	486,5	101,0	38,0	255,0	24,5	0,0	231,5
91-180	167,1	96,4	1,1	67,0	35,3	40,1	60,0
>180	86,4	485,0	482,0	72,0	3,0	14,4	0,0
<b>Total</b>	<b>2317,6</b>	<b>2257,4</b>	<b>895,3</b>	<b>990,9</b>	<b>629,2</b>	<b>400,6</b>	<b>926,0</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.71%	6.67%	4.54%	6.25%
15-35	6.68%	6.17%	6.58%	6.51%
36-60	6.77%	6.82%	6.74%	6.76%
61-90	6.87%	7.08%	6.70%	6.80%
91-180	7.18%	7.38%	7.11%	7.18%
>180	—	7.78%	7.49%	7.54%
<b>Total</b>	<b>6.74%</b>	<b>6.64%</b>	<b>6.23%</b>	<b>6.52%</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	21 – 25 nov.				28 nov. - 02 dic.				05 - 09 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	17	130	4246	4493	26	228	6188	7539	12	176	4511	4674
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	2	0	2394	2298	0	0	3537	2649	0	0	2408	1698
Otros <sup>c</sup>	128	17	1302	1124	228	26	2049	1542	176	12	717	1193
<b>Total</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>7942</b>	<b>7915</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>11774</b>	<b>11730</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>7636</b>	<b>7565</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.