

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2022**  
**Fecha de Información: 25 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\$2610 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.48%<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	306,4	476,8	37,0	108,8	270,8	28,6	169,0
15-35	600,5	652,0	231,7	183,6	42,2	38,9	378,0
36-60	76,3	21,6	0,0	1,1	21,6	75,3	0,0
61-90	425,8	32,1	0,0	414,3	22,1	1,5	10,0
91-180	120,5	314,5	203,1	5,0	21,4	25,5	90,0
>180	4,6	230,6	223,1	0,0	2,9	0,0	4,6
<b>Total</b>	<b>1534,2</b>	<b>1727,5</b>	<b>694,9</b>	<b>712,7</b>	<b>381,0</b>	<b>169,9</b>	<b>651,6</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	6.69%		6.59%	4.52%	6.31%
15-35	6.68%		5.68%	6.44%	6.37%
36-60	—		6.96%	6.73%	6.78%
61-90	6.88%		7.22%	6.85%	7.10%
91-180	7.30%		7.49%	7.13%	7.29%
>180	7.62%		7.72%	—	7.66%
<b>Total</b>	<b>6.78%</b>		<b>6.37%</b>	<b>6.07%</b>	<b>6.48%</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: ((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

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>	12	53	671	741	29	230	6587	8064	13	177	4610	4707
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	230	231	0	0	3654	2891	0	0	2409	1760
Otros <sup>c</sup>	53	12	375	304	230	29	2314	1556	177	13	724	1206
<b>Total</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>1276</b>	<b>1276</b>	<b>259</b>	<b>259</b>	<b>12555</b>	<b>12511</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>7743</b>	<b>7673</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.