

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$2118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.76%<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	453,6	401,8	130,9	284,9	116,9	14,7	154,0
15-35	547,0	563,5	362,9	380,5	69,6	35,6	131,0
36-60	75,5	60,4	7,0	1,1	49,0	70,0	4,5
61-90	16,3	47,7	5,0	5,0	32,7	1,3	10,0
91-180	44,9	85,1	0,9	0,0	52,2	12,9	32,0
>180	80,0	83,3	40,3	70,0	33,0	0,0	10,0
<b>Total</b>	<b>1217,3</b>	<b>1242,0</b>	<b>547,1</b>	<b>741,4</b>	<b>353,5</b>	<b>134,5</b>	<b>341,4</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	5.57%		6.79%	6.67%	6.32%
15-35	6.82%		6.81%	6.64%	6.74%
36-60	6.70%		6.98%	6.78%	6.86%
61-90	6.99%		7.10%	6.94%	7.06%
91-180	7.15%		7.38%	6.99%	7.25%
>180	7.38%		7.50%	7.82%	7.64%
<b>Total</b>	<b>6.30%</b>		<b>6.96%</b>	<b>6.81%</b>	<b>6.76%</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	28 nov. - 02 dic.				05 - 09 dic.				12 - 16 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	10	116	3144	3080	21	190	5085	5941	48	186	6613	7912
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1545	1793	0	0	2595	2028	1	0	4593	2994
Otros <sup>c</sup>	116	10	733	512	190	21	1634	1274	185	48	693	665
<b>Total</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>5422</b>	<b>5385</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>9314</b>	<b>9243</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>11899</b>	<b>11571</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.