

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2022**

**Fecha de Información: 11 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\$937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.25%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,2	90,1	61,2	0,9	23,9	15,3	5
15-35	300,6	264,8	204,4	249,9	15,4	5,7	45
36-60	46,2	8,6	2,7	42,0	5,8	4,2	0
61-90	120,4	94,2	30,0	68,0	14,2	2,4	50
91-180	41,9	61,6	20,0	20,0	21,6	1,9	20
>180	2,1	5,6	0,0	0,0	5,6	2,1	0
<b>Total</b>	<b>532,4</b>	<b>524,8</b>	<b>318,3</b>	<b>380,8</b>	<b>86,5</b>	<b>31,6</b>	<b>120</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	6.92%		6.80%	-5.22%	4.58%
15-35	6.25%		6.25%	6.24%	6.24%
36-60	-		8.14%	6.54%	6.73%
61-90	6.55%		7.06%	6.63%	6.64%
91-180	6.99%		7.30%	6.98%	7.09%
>180	-		8.09%	7.55%	7.94%
<b>Total</b>	<b>6.53%</b>		<b>6.65%</b>	<b>5.83%</b>	<b>6.25%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	07 – 11 nov.				14 - 18 nov.				21 - 25 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	0	3	1	3	59	183	6947	7178	13	179	5767	6118
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	0	0	0	0	3921	3430	2	0	4184	2932
Otros <sup>c</sup>	3	0	3	1	183	59	1955	2160	177	13	518	1381
<b>Total</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>4</b>	<b>4</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>12823</b>	<b>12768</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>10469</b>	<b>10431</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.