

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2022**

**Fecha de Información: 16 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\$5260 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.21%<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	419,1	1097,3	286,3	214,5	694,6	88,1	116,5
15-35	723,0	560,5	335,2	469,6	32,9	61,0	192,4
36-60	2,8	489,5	480,0	0,5	9,5	2,3	0,0
61-90	448,9	7,6	0,0	83,6	7,6	365,3	0,0
91-180	445,2	657,7	560,0	58,3	37,3	326,6	60,4
>180	746,0	46,8	30,0	728,0	1,8	3,0	15,0
<b>Total</b>	<b>2785,0</b>	<b>2859,5</b>	<b>1691,4</b>	<b>1554,5</b>	<b>783,7</b>	<b>846,2</b>	<b>384,3</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	6.56%		5.03%	6.42%	5.48%
15-35	6.49%		6.58%	6.51%	6.54%
36-60	-		6.76%	6.43%	6.70%
61-90	-		7.07%	6.65%	6.66%
91-180	7.12%		6.65%	6.82%	6.80%
>180	7.29%		7.26%	7.22%	7.27%
<b>Total</b>	<b>6.64%</b>		<b>5.69%</b>	<b>6.63%</b>	<b>6.21%</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

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>	36	106	6024	5895	14	185	6195	7642	23	220	4939	5027
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3737	3313	2	0	4321	3197	0	0	2908	2119
Otros <sup>c</sup>	106	36	890	1416	183	14	1827	1453	220	23	813	1469
<b>Total</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>10651</b>	<b>10624</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>12343</b>	<b>12292</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>8660</b>	<b>8615</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.