

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 09 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\$3768 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.59%<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	896,8	944,4	531,9	694,8	225,5	15,0	187,0
15-35	500,5	487,0	261,2	313,0	58,6	20,3	167,2
36-60	321,9	132,5	70,0	62,0	23,6	221,0	38,9
61-90	230,8	113,8	5,0	135,0	13,8	0,8	95,0
91-180	128,7	360,7	223,0	1,1	18,0	7,8	119,7
>180	69,9	248,8	185,0	0,0	3,8	9,9	60,0
<b>Total</b>	<b>2148,5</b>	<b>2287,3</b>	<b>1276,1</b>	<b>1205,9</b>	<b>343,4</b>	<b>274,8</b>	<b>667,8</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	6.94%	7.25%	5.14%	6.21%
15-35	6.89%	6.96%	6.14%	6.61%
36-60	6.81%	6.64%	6.86%	6.80%
61-90	7.17%	7.28%	7.26%	7.19%
91-180	6.12%	6.94%	7.01%	6.68%
>180	7.42%	7.29%	7.27%	7.32%
<b>Total</b>	<b>6.85%</b>	<b>7.07%</b>	<b>5.88%</b>	<b>6.59%</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	05 – 09 dic.				12 - 16 dic.				19 - 23 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	6	79	645	736	68	192	8727	10044	38	367	6677	7384
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	169	303	1	0	5179	4027	0	0	4551	3900
Otros <sup>c</sup>	79	6	340	103	191	68	1244	748	367	38	433	369
<b>Total</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>1154</b>	<b>1142</b>	<b>260</b>	<b>260</b>	<b>15150</b>	<b>14819</b>	<b>405</b>	<b>405</b>	<b>11661</b>	<b>11653</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.