

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 14 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\$1990 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.94%<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	365,6	353,6	121,4	183,1	120,2	70,5	112,0
15-35	589,4	517,6	196,2	291,2	40,1	16,9	281,3
36-60	92,5	38,7	15,6	19,5	19,1	69,0	4,0
61-90	143,3	207,9	63,2	25,0	84,6	58,3	60,0
91-180	26,4	47,7	0,0	0,0	47,7	26,4	0,0
>180	36,9	32,5	20,0	0,0	7,5	31,9	5,0
<b>Total</b>	<b>1254,0</b>	<b>1197,9</b>	<b>416,5</b>	<b>518,8</b>	<b>319,2</b>	<b>272,9</b>	<b>462,3</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.88%		6.89%	6.64%	6.77%
15-35	6.84%		6.94%	6.80%	6.87%
36-60	6.93%		7.12%	6.92%	6.98%
61-90	7.26%		7.12%	7.07%	7.14%
91-180	—		7.43%	7.15%	7.33%
>180	7.57%		7.58%	7.55%	7.56%
<b>Total</b>	<b>6.91%</b>		<b>7.05%</b>	<b>6.85%</b>	<b>6.94%</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	12 – 16 dic.				19 - 23 dic.				26 - 30 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	44	144	6832	7012	45	381	7302	8254	16	190	3163	3617
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	3746	3489	0	0	4972	4089	0	0	2252	2006
Otros <sup>c</sup>	143	44	757	524	381	45	580	502	190	16	427	205
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>11335</b>	<b>11025</b>	<b>426</b>	<b>426</b>	<b>12854</b>	<b>12845</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>5842</b>	<b>5828</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.