

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 15 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\$2783 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.51%<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	583,9	537,7	441,2	457,2	18,0	48,2	78,5
15-35	674,4	716,5	464,0	386,2	15,7	51,4	236,7
36-60	46,6	59,0	40,9	2,3	18,1	44,3	0,0
61-90	208,3	101,3	20,0	160,0	36,6	3,6	44,7
91-180	42,3	54,1	28,7	0,0	25,4	42,3	0,0
>180	26,0	113,0	82,4	0,0	10,6	6,0	20,0
<b>Total</b>	<b>1581,5</b>	<b>1581,6</b>	<b>1077,1</b>	<b>1005,7</b>	<b>124,5</b>	<b>195,8</b>	<b>379,9</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	6.69%		5.45%	6.86%	6.39%
15-35	6.67%		6.36%	6.02%	6.34%
36-60	—		7.00%	6.82%	6.88%
61-90	6.99%		7.09%	6.97%	7.02%
91-180	—		7.40%	7.08%	7.20%
>180	7.49%		7.67%	7.44%	7.53%
<b>Total</b>	<b>6.75%</b>		<b>6.32%</b>	<b>6.55%</b>	<b>6.51%</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>	31	99	3414	3724	60	386	7501	8631	17	191	3276	3624
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	2464	2310	0	0	5302	4231	0	0	2253	2107
Otros <sup>c</sup>	98	31	422	262	386	60	588	521	191	17	432	218
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>6300</b>	<b>6296</b>	<b>446</b>	<b>446</b>	<b>13391</b>	<b>13383</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>5961</b>	<b>5949</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.