

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 21 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\$1553 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.99%<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	386,7	73,6	68,0	343,9	5,6	42,8	0,0
15-35	302,7	589,8	429,7	247,3	112,8	8,0	47,4
36-60	21,4	21,1	1,1	0,0	20,0	21,4	0,0
61-90	46,3	98,4	36,3	30,2	47,1	1,1	15,0
91-180	21,2	23,7	1,4	0,0	12,3	11,2	10,0
>180	14,2	36,3	20,0	0,0	6,3	4,2	10,0
<b>Total</b>	<b>792,6</b>	<b>842,9</b>	<b>556,5</b>	<b>621,4</b>	<b>204,1</b>	<b>88,8</b>	<b>82,4</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	–		10.03%	6.66%	6.98%
15-35	6.81%		6.93%	6.83%	6.89%
36-60	–		7.06%	6.88%	6.97%
61-90	7.25%		7.25%	7.14%	7.23%
91-180	7.36%		7.49%	7.18%	7.35%
>180	7.65%		7.69%	7.52%	7.66%
<b>Total</b>	<b>7.06%</b>		<b>7.18%</b>	<b>6.77%</b>	<b>6.99%</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	19 – 23 dic.				26 - 30 dic.				02 - 06 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	49	301	3601	3888	21	191	3603	3889	3	79	3089	3427
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2711	2339	0	0	2444	2362	0	0	2203	1976
Otros <sup>c</sup>	301	49	303	380	191	21	453	236	79	3	271	134
<b>Total</b>	<b>350</b>	<b>350</b>	<b>6615</b>	<b>6607</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>6500</b>	<b>6487</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>5563</b>	<b>5537</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.