

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 23 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\$1325 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.01%<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	45,2	81,3	56,6	31,2	16,8	6,0	8
15-35	527,5	308,1	259,6	493,2	31,5	17,3	17
36-60	11,9	14,7	0,3	3,2	14,3	8,8	0
61-90	12,6	240,3	203,7	0,0	26,6	2,6	10
91-180	20,2	43,9	0,0	0,0	28,9	5,2	15
>180	49,3	43,7	0,0	20,0	19,7	5,3	24
<b>Total</b>	<b>666,7</b>	<b>731,9</b>	<b>520,2</b>	<b>547,6</b>	<b>137,7</b>	<b>45,1</b>	<b>74</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	6.54%		6.72%	6.48%	6.60%
15-35	6.63%		6.84%	6.58%	6.69%
36-60	—		7.22%	6.70%	7.02%
61-90	6.97%		7.31%	6.89%	7.19%
91-180	7.56%		7.57%	7.22%	7.53%
>180	7.76%		7.77%	7.48%	7.73%
<b>Total</b>	<b>7.22%</b>		<b>7.15%</b>	<b>6.64%</b>	<b>7.01%</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>	4	35	1201	1206	24	191	3641	4037	3	82	3162	3483
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	801	787	0	0	2575	2383	0	0	2236	2039
Otros <sup>c</sup>	35	4	50	59	191	24	466	248	82	3	286	137
<b>Total</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>2052</b>	<b>2052</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>6682</b>	<b>6668</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>5684</b>	<b>5659</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.