

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 26 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\$42 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.65%<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         | 8,7                            | 0,5         | 0                                   | 7        | 0,5           | 1,7         | 0                  | 0         |
| 15-35        | 9,1                            | 5,5         | 0                                   | 2        | 5,5           | 7,1         | 0                  | 0         |
| 36-60        | 1,1                            | 2,6         | 0                                   | 0        | 2,6           | 1,1         | 0                  | 0         |
| 61-90        | 1,3                            | 6,0         | 0                                   | 0        | 6,0           | 1,3         | 0                  | 0         |
| 91-180       | 2,5                            | 3,3         | 0                                   | 0        | 3,3           | 2,5         | 0                  | 0         |
| >180         | 0,5                            | 0,7         | 0                                   | 0        | 0,7           | 0,5         | 0                  | 0         |
| <b>Total</b> | <b>23,3</b>                    | <b>18,6</b> | <b>0</b>                            | <b>9</b> | <b>18,6</b>   | <b>14,3</b> | <b>0</b>           | <b>0</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         | —   |  | 6.87%                        | 5.64%        | 5.70%        |
| 15-35        | —   |  | 6.81%                        | 6.34%        | 6.54%        |
| 36-60        | —   |  | 7.05%                        | 6.07%        | 6.76%        |
| 61-90        | —   |  | 7.39%                        | 6.70%        | 7.27%        |
| 91-180       | —   |  | 7.47%                        | 7.19%        | 7.34%        |
| >180         | —   |  | 7.49%                        | 7.20%        | 7.37%        |
| <b>Total</b> | <b>0.00%</b>                                      |  | <b>7.18%</b>                 | <b>6.18%</b> | <b>6.65%</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                            | 26 – 30 dic. |            |             |             | 02 - 06 ene. |           |             |             | 09 - 13 ene. |            |             |             |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
|                                     | Delivery     |            | NDF         |             | Delivery     |           | NDF         |             | Delivery     |            | NDF         |             |
|                                     | C            | V          | C           | V           | C            | V         | C           | V           | C            | V          | C           | V           |
| Sector Financiero <sup>a</sup>      | 24           | 188        | 3641        | 4041        | 4            | 86        | 3170        | 3483        | 20           | 144        | 4168        | 4856        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 2575        | 2383        | 0            | 0         | 2236        | 2046        | 0            | 0          | 3210        | 2650        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 188          | 24         | 470         | 248         | 86           | 4         | 286         | 138         | 144          | 20         | 362         | 188         |
| <b>Total</b>                        | <b>212</b>   | <b>212</b> | <b>6686</b> | <b>6672</b> | <b>90</b>    | <b>90</b> | <b>5692</b> | <b>5667</b> | <b>164</b>   | <b>164</b> | <b>7740</b> | <b>7694</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.