

# 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>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,7	0,5	0	7	0,5	1,7	0
15-35	9,1	5,5	0	2	5,5	7,1	0
36-60	1,1	2,6	0	0	2,6	1,1	0
61-90	1,3	6,0	0	0	6,0	1,3	0
91-180	2,5	3,3	0	0	3,3	2,5	0
>180	0,5	0,7	0	0	0,7	0,5	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>

<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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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.