

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 28 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\$1527 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.78%<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	78,8	187,1	178,0	64,0	9,1	14,8	0,0
15-35	452,0	513,3	332,7	299,0	87,5	59,9	93,1
36-60	84,2	24,9	14,1	75,0	10,7	9,2	0,0
61-90	67,7	47,8	22,0	53,4	25,7	14,4	0,0
91-180	61,9	78,4	0,0	10,0	38,4	0,0	51,9
>180	10,7	75,2	5,6	0,0	59,7	0,7	10,0
<b>Total</b>	<b>755,3</b>	<b>926,6</b>	<b>552,4</b>	<b>501,3</b>	<b>231,1</b>	<b>99,0</b>	<b>155,0</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	–		6.35%	7.84%	6.85%
15-35	6.57%		6.63%	6.41%	6.52%
36-60	–		6.72%	6.48%	6.51%
61-90	–		7.43%	6.95%	7.29%
91-180	7.33%		7.58%	7.39%	7.44%
>180	7.77%		7.65%	7.58%	7.67%
<b>Total</b>	<b>6.87%</b>		<b>6.84%</b>	<b>6.68%</b>	<b>6.78%</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>	15	109	1756	1991	11	87	3264	3539	23	148	4300	5115
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1218	1071	0	0	2274	2115	0	0	3430	2721
Otros <sup>c</sup>	109	15	311	210	87	11	303	163	148	23	368	215
<b>Total</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>3285</b>	<b>3272</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>5841</b>	<b>5817</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>8098</b>	<b>8051</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.