

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 02 de enero de 2023<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\$137 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.15%<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 Mercado Cambiario	
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado	Cambiario
3-14	46,6	41,3	32,1	32,4	3,2	8,3	6	
15-35	4,5	12,7	0,0	0,0	12,7	4,5	0	
36-60	8,6	3,0	0,0	0,0	3,0	8,6	0	
61-90	3,3	10,4	7,7	0,0	2,7	3,3	0	
91-180	0,8	2,0	0,0	0,0	2,0	0,8	0	
>180	5,1	4,4	0,0	0,0	4,4	5,1	0	
<b>Total</b>	<b>69,0</b>	<b>73,9</b>	<b>39,8</b>	<b>32,4</b>	<b>28,1</b>	<b>30,7</b>	<b>6</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	2.66%		5.43%	0.50%	2.79%
15-35	–		6.22%	6.42%	6.27%
36-60	–		7.12%	5.17%	5.68%
61-90	–		7.07%	7.17%	7.13%
91-180	–		7.60%	6.97%	7.42%
>180	–		7.27%	7.10%	7.18%
<b>Total</b>	<b>2.66%</b>		<b>5.96%</b>	<b>2.55%</b>	<b>4.15%</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	02 – 06 ene.				09 - 13 ene.				16 - 20 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	13	94	3386	3612	27	151	5380	5264	19	165	4821	4737
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2300	2181	0	0	3555	3777	0	0	2883	2053
Otros <sup>c</sup>	94	13	305	173	151	27	368	217	165	19	1077	1975
<b>Total</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>5991</b>	<b>5966</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>9303</b>	<b>9258</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>8781</b>	<b>8765</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.