

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 04 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\$1720 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.62%<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	
3-14	323,9	248,9	124,1	172,8	9,4	35,6	115,5
15-35	411,1	622,1	479,3	272,4	29,5	25,4	113,3
36-60	2,9	16,3	10,0	0,0	6,3	2,9	0,0
61-90	24,9	118,3	20,0	0,0	78,3	4,9	20,0
91-180	0,5	6,5	0,0	0,0	6,5	0,5	0,0
>180	92,4	121,3	95,0	70,0	6,3	2,4	20,0
<b>Total</b>	<b>855,8</b>	<b>1133,5</b>	<b>728,4</b>	<b>515,1</b>	<b>136,3</b>	<b>71,8</b>	<b>268,8</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	6.38%	6.40%	6.42%	6.40%
15-35	6.37%	6.44%	6.29%	6.37%
36-60	—	7.16%	6.42%	7.05%
61-90	7.24%	7.15%	6.98%	7.16%
91-180	—	7.46%	7.37%	7.45%
>180	7.96%	7.80%	7.77%	7.81%
<b>Total</b>	<b>6.55%</b>	<b>6.74%</b>	<b>6.50%</b>	<b>6.62%</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	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>	8	82	3106	3056	27	159	5571	5536	21	166	5002	4969
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1913	2038	0	0	3686	3806	0	0	3058	2163
Otros <sup>c</sup>	82	8	275	174	159	27	379	247	166	21	1083	1996
<b>Total</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>5294</b>	<b>5268</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>9636</b>	<b>9589</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>9143</b>	<b>9128</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.