

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 06 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\$2368 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.92%<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	467,5	407,0	11,7	202,9	189,4	58,6	206
15-35	559,3	732,8	397,2	293,8	81,6	11,5	254
36-60	10,7	180,7	148,0	5,5	32,7	5,2	0
61-90	125,4	257,6	120,3	0,0	17,4	5,4	120
91-180	80,1	21,1	0,8	0,0	20,3	80,1	0
>180	45,0	71,1	50,8	35,0	10,3	0,0	10
<b>Total</b>	<b>1288,0</b>	<b>1670,3</b>	<b>728,7</b>	<b>537,1</b>	<b>351,6</b>	<b>160,9</b>	<b>590</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	6.96%	5.96%	6.69%	6.55%
15-35	6.95%	7.36%	5.25%	6.80%
36-60	—	7.28%	7.08%	7.26%
61-90	7.76%	6.96%	7.44%	7.34%
91-180	—	7.63%	7.06%	7.17%
>180	8.08%	8.20%	8.20%	8.19%
<b>Total</b>	<b>7.14%</b>	<b>7.07%</b>	<b>6.39%</b>	<b>6.92%</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>	5	26	307	368	33	163	6394	5810	22	171	5438	5704
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	242	181	0	0	3871	4485	0	0	3139	2245
Otros <sup>c</sup>	26	5	74	53	163	33	383	294	171	22	1532	2144
<b>Total</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>623</b>	<b>602</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>10648</b>	<b>10589</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>10109</b>	<b>10093</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.