

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de enero de 2023**

**Fecha de Información: 16 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\$529 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.73%<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	142,1	200,3	98,0	44,5	12,8	8,1	89,5
15-35	167,7	136,9	25,6	85,8	29,8	0,5	81,5
36-60	2,3	10,2	2,2	0,0	8,0	2,3	0,0
61-90	1,3	5,2	0,0	0,0	5,2	1,3	0,0
91-180	1,0	19,0	0,3	0,0	18,7	1,0	0,0
>180	4,4	9,7	0,7	0,0	9,0	4,4	0,0
<b>Total</b>	<b>318,7</b>	<b>381,3</b>	<b>126,8</b>	<b>130,2</b>	<b>83,5</b>	<b>17,5</b>	<b>171,0</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	4.80%	7.38%	7.31%	5.88%
15-35	7.14%	7.50%	7.02%	7.21%
36-60	—	7.87%	7.15%	7.71%
61-90	—	8.09%	7.70%	8.01%
91-180	—	8.12%	7.76%	8.10%
>180	—	8.32%	8.16%	8.27%
<b>Total</b>	<b>5.92%</b>	<b>7.69%</b>	<b>7.27%</b>	<b>6.73%</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	16 – 20 ene.				23 - 27 ene.				30 ene. - 03 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	25	202	6830	7074	14	272	6367	6092	21	139	5091	3739
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3671	3078	0	0	4339	3285	0	0	1869	2434
Otros <sup>c</sup>	202	25	2001	2335	272	14	766	2075	139	21	600	1371
<b>Total</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>12502</b>	<b>12487</b>	<b>286</b>	<b>286</b>	<b>11472</b>	<b>11452</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>7560</b>	<b>7544</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.