

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2022**  
**Fecha de Información: 20 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\$1954 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.64%<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	241,8	98,0	87,0	225,0	9,0	14,8	2,0
15-35	593,2	824,1	557,3	381,0	74,3	19,8	192,5
36-60	16,9	22,4	0,0	0,0	12,4	6,9	10,0
61-90	105,9	205,4	89,7	18,2	30,6	2,7	85,0
91-180	5,3	30,0	4,0	0,0	26,0	5,3	0,0
>180	45,8	85,3	50,0	15,0	5,3	0,8	30,0
<b>Total</b>	<b>1008,9</b>	<b>1265,1</b>	<b>788,0</b>	<b>639,1</b>	<b>157,6</b>	<b>50,3</b>	<b>319,5</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	6.93%		6.74%	5.72%	5.86%
15-35	6.89%		6.70%	6.22%	6.59%
36-60	7.19%		7.31%	6.77%	7.14%
61-90	7.27%		7.29%	7.24%	7.27%
91-180	-		7.48%	7.14%	7.43%
>180	7.51%		7.58%	7.50%	7.55%
<b>Total</b>	<b>7.05%</b>		<b>6.89%</b>	<b>6.09%</b>	<b>6.64%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	19 – 23 dic.				26 - 30 dic.				02 - 06 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	61	340	3885	4673	19	192	3554	3869	3	79	3002	3412
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3126	2287	0	0	2424	2322	0	0	2189	1920
Otros <sup>c</sup>	340	61	413	457	192	19	453	227	79	3	269	103
<b>Total</b>	<b>401</b>	<b>401</b>	<b>7424</b>	<b>7417</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>6431</b>	<b>6418</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>5460</b>	<b>5435</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.