

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 17 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\$2843 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.50%<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	611,4	731,9	319,7	314,1	183,2	68,3	229,0
15-35	810,8	802,8	430,2	419,8	106,6	125,0	266,0
36-60	22,7	81,4	19,7	0,0	53,6	14,6	8,1
61-90	16,6	59,9	22,3	10,0	32,6	1,6	5,0
91-180	6,9	70,5	0,0	6,5	70,5	0,4	0,0
>180	65,5	120,7	40,0	15,5	30,7	0,0	50,0
<b>Total</b>	<b>1534,0</b>	<b>1867,2</b>	<b>831,8</b>	<b>765,9</b>	<b>477,3</b>	<b>210,0</b>	<b>558,1</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	7.47%		7.45%	7.36%	7.42%
15-35	7.43%		7.53%	7.36%	7.46%
36-60	7.19%		7.52%	7.31%	7.45%
61-90	7.88%		7.85%	7.89%	7.86%
91-180	-		7.99%	7.63%	7.98%
>180	8.14%		8.12%	8.08%	8.13%
<b>Total</b>	<b>7.51%</b>		<b>7.59%</b>	<b>7.39%</b>	<b>7.50%</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

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>	26	201	7423	7401	16	272	6403	6395	21	139	5146	3893
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3739	3389	0	0	4586	3288	0	0	1874	2447
Otros <sup>c</sup>	201	26	2079	2436	272	16	793	2079	139	21	728	1393
<b>Total</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>13241</b>	<b>13226</b>	<b>288</b>	<b>288</b>	<b>11782</b>	<b>11762</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>7748</b>	<b>7733</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.