

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 18 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\$2887 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.57%<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	295,4	971,9	514,0	144,7	326,8	19,5	131,2
15-35	891,6	448,4	241,2	418,2	69,4	335,7	137,7
36-60	176,5	29,5	0,0	169,2	24,5	2,4	5,0
61-90	52,2	104,8	70,0	0,0	24,4	41,8	10,4
91-180	79,6	45,5	0,0	75,0	45,5	4,6	0,0
>180	58,5	26,8	10,5	44,0	6,4	4,5	10,0
<b>Total</b>	<b>1553,9</b>	<b>1627,0</b>	<b>835,7</b>	<b>851,1</b>	<b>496,9</b>	<b>408,5</b>	<b>294,3</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	7.71%		7.42%	7.28%	7.45%
15-35	7.58%		7.63%	7.52%	7.55%
36-60	7.97%		7.84%	7.78%	7.81%
61-90	7.81%		7.96%	7.63%	7.83%
91-180	-		8.16%	7.70%	8.12%
>180	8.12%		8.34%	8.18%	8.18%
<b>Total</b>	<b>7.67%</b>		<b>7.57%</b>	<b>7.54%</b>	<b>7.57%</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>	15	163	5214	5220	18	272	6524	7109	22	141	5188	3937
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3099	2756	0	0	4916	3315	0	0	1874	2463
Otros <sup>c</sup>	163	15	1008	1338	272	18	1092	2086	141	22	752	1399
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>9321</b>	<b>9314</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>12532</b>	<b>12510</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>7814</b>	<b>7799</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.