

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de enero de 2023**  
**Fecha de Información: 19 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\$4977 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.43%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	661,2	1593,8	668,3	274,5	589,5	50,7	336
15-35	1488,7	605,0	206,3	993,0	80,7	177,7	318
36-60	12,0	109,2	93,0	2,9	16,2	9,1	0
61-90	390,1	19,4	0,0	25,0	19,4	365,1	0
91-180	133,6	353,7	282,7	118,5	55,9	0,1	15
>180	147,4	161,3	100,0	115,0	31,3	2,4	30
<b>Total</b>	<b>2833,1</b>	<b>2842,4</b>	<b>1350,4</b>	<b>1528,9</b>	<b>793,0</b>	<b>605,2</b>	<b>699</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	7.63%		6.79%	7.33%	7.06%
15-35	7.60%		7.70%	7.58%	7.61%
36-60	-		8.06%	5.86%	7.14%
61-90	-		8.07%	7.68%	7.70%
91-180	7.91%		8.03%	8.13%	8.03%
>180	8.13%		8.26%	8.14%	8.20%
<b>Total</b>	<b>7.64%</b>		<b>7.20%</b>	<b>7.56%</b>	<b>7.43%</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>	9	98	3733	3768	19	280	7125	8341	22	145	5254	4168
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2254	1841	0	0	5342	3620	0	0	2036	2463
Otros <sup>c</sup>	98	9	597	974	280	19	1645	2130	145	22	771	1415
<b>Total</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>6584</b>	<b>6583</b>	<b>299</b>	<b>299</b>	<b>14112</b>	<b>14091</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>8061</b>	<b>8046</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.