

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 02 de febrero 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\$2687 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.52%<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	307,8	583,3	391,3	203,3	144,8	57,3	47,2
15-35	667,6	753,1	520,5	418,0	33,0	49,9	199,7
36-60	213,5	28,0	4,4	79,5	23,6	134,0	0,0
61-90	42,0	53,9	0,0	0,0	13,9	2,0	40,0
91-180	30,1	27,8	0,0	26,5	27,8	3,6	0,0
>180	200,3	86,8	55,0	180,0	11,8	0,3	20,0
<b>Total</b>	<b>1461,4</b>	<b>1532,8</b>	<b>971,2</b>	<b>907,3</b>	<b>254,8</b>	<b>247,3</b>	<b>306,9</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	7.88%		6.94%	6.71%	6.93%
15-35	7.80%		7.89%	7.65%	7.77%
36-60	-		8.31%	7.81%	7.89%
61-90	7.97%		8.21%	7.93%	8.03%
91-180	-		8.16%	7.82%	8.07%
>180	7.77%		7.76%	7.76%	7.76%
<b>Total</b>	<b>7.83%</b>		<b>7.49%</b>	<b>7.44%</b>	<b>7.52%</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	30 ene. - 03 feb.				06 - 10 feb.				13 - 17 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	20	76	3789	3810	27	205	6514	6797	34	245	5603	5638
Intragrupa y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2221	2357	0	0	3819	3261	0	0	3274	2368
Otros <sup>c</sup>	76	20	680	523	205	27	881	1109	245	34	724	1575
<b>Total</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>6690</b>	<b>6690</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>11214</b>	<b>11167</b>	<b>279</b>	<b>279</b>	<b>9601</b>	<b>9581</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.