

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 03 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\$4202 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.66%<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	502,7	835,0	441,8	338,5	264,2	35,2	129,0
15-35	1000,1	1268,2	993,1	514,0	0,0	320,6	165,5
36-60	200,3	137,8	5,5	0,0	6,3	74,3	126,0
61-90	436,2	178,4	38,0	294,2	4,4	6,0	136,0
91-180	1,5	20,0	9,8	0,0	10,2	1,5	0,0
>180	145,6	82,9	30,0	85,0	2,9	10,6	50,0
<b>Total</b>	<b>2286,5</b>	<b>2522,3</b>	<b>1518,3</b>	<b>1231,7</b>	<b>287,9</b>	<b>448,2</b>	<b>606,5</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	7.84%		7.14%	7.34%	7.28%
15-35	7.83%		7.85%	7.81%	7.83%
36-60	7.83%		8.28%	7.88%	7.86%
61-90	7.91%		8.22%	7.82%	7.90%
91-180	-		8.01%	7.70%	7.99%
>180	7.79%		7.64%	7.72%	7.72%
<b>Total</b>	<b>7.85%</b>		<b>7.52%</b>	<b>7.71%</b>	<b>7.66%</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

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>	8	40	532	509	28	209	6927	7401	41	245	5666	5823
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	201	262	0	0	4029	3531	0	0	3453	2412
Otros <sup>c</sup>	40	8	179	141	209	28	1140	1117	245	41	731	1595
<b>Total</b>	<b>48</b>	<b>48</b>	<b>912</b>	<b>912</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>12096</b>	<b>12049</b>	<b>286</b>	<b>286</b>	<b>9850</b>	<b>9830</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.