

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 06 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\$2638 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.73%<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	193,1	656,1	252,3	111,0	359,8	38,1	44,0
15-35	1026,3	697,5	458,1	279,8	47,2	554,3	192,3
36-60	85,6	44,6	35,0	70,0	9,6	15,6	0,0
61-90	11,7	15,3	10,0	1,8	5,3	9,9	0,0
91-180	13,9	43,6	7,4	0,0	36,2	13,9	0,0
>180	85,2	6,0	0,0	77,0	1,0	3,2	5,0
<b>Total</b>	<b>1415,9</b>	<b>1463,1</b>	<b>762,7</b>	<b>539,6</b>	<b>459,1</b>	<b>635,0</b>	<b>241,3</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	7.90%		7.75%	6.69%	7.64%
15-35	7.77%		7.85%	7.73%	7.77%
36-60	-		7.59%	7.76%	7.73%
61-90	-		8.15%	7.69%	7.84%
91-180	-		7.99%	7.62%	7.90%
>180	7.68%		8.01%	7.67%	7.68%
<b>Total</b>	<b>7.79%</b>		<b>7.80%</b>	<b>7.65%</b>	<b>7.73%</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	06 – 10 feb.				13 - 17 feb.				20 - 24 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	30	209	7257	7641	42	246	5755	6265	19	257	7055	6377
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4098	3710	0	0	3665	2473	0	0	3963	3850
Otros <sup>c</sup>	209	30	1269	1226	246	42	961	1623	257	19	613	1384
<b>Total</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>12624</b>	<b>12577</b>	<b>288</b>	<b>288</b>	<b>10381</b>	<b>10361</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>11631</b>	<b>11611</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.