

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 09 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\$2528 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.60%<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	352,7	433,2	104,5	78,5	74,6	20,2	254,1
15-35	1052,6	815,5	381,0	478,7	15,5	154,9	419,0
36-60	29,3	74,0	40,0	0,0	34,0	29,3	0,0
61-90	105,5	55,6	1,6	65,0	14,0	0,5	40,0
91-180	65,3	143,3	60,9	10,0	27,4	0,3	55,0
>180	15,0	168,5	148,2	0,0	5,2	0,0	15,0
<b>Total</b>	<b>1620,5</b>	<b>1690,1</b>	<b>736,3</b>	<b>632,2</b>	<b>170,7</b>	<b>205,2</b>	<b>783,1</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	7.96%		7.46%	7.24%	7.67%
15-35	7.92%		6.72%	7.64%	7.48%
36-60	-		7.93%	7.80%	7.89%
61-90	7.85%		8.07%	7.82%	7.88%
91-180	7.91%		7.93%	7.97%	7.93%
>180	7.70%		8.09%	7.68%	7.80%
<b>Total</b>	<b>7.92%</b>		<b>7.19%</b>	<b>7.60%</b>	<b>7.60%</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>	18	93	4953	5030	49	253	6612	7763	20	259	7227	6594
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2635	2736	0	0	4170	2970	0	0	4012	3868
Otros <sup>c</sup>	93	18	582	385	253	49	1663	1692	259	20	648	1405
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>8170</b>	<b>8151</b>	<b>302</b>	<b>302</b>	<b>12445</b>	<b>12425</b>	<b>279</b>	<b>279</b>	<b>11887</b>	<b>11867</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.