

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 14 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\$3664 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.24%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	938,1	745,7	238,5	581,3	175,8	0,0	356,7
15-35	576,9	933,0	690,6	226,2	44,5	152,7	198,0
36-60	333,0	396,4	89,4	0,0	7,1	33,0	300,0
61-90	281,8	281,8	128,1	0,0	3,8	131,8	150,0
91-180	10,1	22,5	0,7	0,0	21,8	10,1	0,0
>180	80,3	83,7	58,0	54,0	10,7	11,3	15,0
<b>Total</b>	<b>2220,1</b>	<b>2463,1</b>	<b>1205,2</b>	<b>861,5</b>	<b>263,5</b>	<b>338,9</b>	<b>1019,7</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	8.01%	4.11%	6.55%	6.29%
15-35	7.94%	7.85%	7.95%	7.89%
36-60	7.92%	7.98%	7.84%	7.91%
61-90	7.93%	8.29%	7.20%	7.60%
91-180	–	8.11%	7.75%	7.99%
>180	7.88%	7.97%	7.79%	7.91%
<b>Total</b>	<b>7.95%</b>	<b>6.68%</b>	<b>7.09%</b>	<b>7.24%</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	13 – 17 feb.				20 - 24 feb.				27 feb. - 03 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	28	228	7080	7971	22	272	7776	7770	28	161	4965	5272
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4309	3352	0	0	4366	4161	0	0	3183	1998
Otros <sup>c</sup>	228	28	1610	1662	272	22	1232	1423	161	28	744	1605
<b>Total</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>12999</b>	<b>12985</b>	<b>294</b>	<b>294</b>	<b>13374</b>	<b>13354</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>8892</b>	<b>8875</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.