

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 20 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\$1758 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.38%<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	226,6	110,2	53,6	174,3	6,6	2,3	50
15-35	268,8	420,7	191,3	37,0	1,4	3,8	228
36-60	15,0	426,7	412,0	0,0	2,7	3,0	12
61-90	232,3	5,6	4,2	231,0	1,4	1,3	0
91-180	136,3	3,6	0,0	136,1	3,6	0,2	0
>180	108,0	94,5	92,0	108,0	2,5	0,0	0
<b>Total</b>	<b>986,9</b>	<b>1061,3</b>	<b>753,2</b>	<b>686,4</b>	<b>18,1</b>	<b>10,5</b>	<b>290</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	7.49%		4.52%	1.37%	3.83%
15-35	7.91%		7.83%	7.21%	7.88%
36-60	7.88%		8.20%	7.70%	7.89%
61-90	-		7.63%	6.44%	7.05%
91-180	-		8.26%	7.90%	8.25%
>180	-		8.91%	-	8.91%
<b>Total</b>	<b>7.84%</b>		<b>6.58%</b>	<b>1.86%</b>	<b>6.38%</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

Sectores	20 – 24 feb.				27 feb. - 03 mar.				06 - 10 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	284	8404	8491	35	161	5919	5894	7	141	6660	6401
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4852	4513	0	0	3357	2431	0	0	3604	2361
Otros <sup>c</sup>	284	28	1256	1488	161	35	812	1747	141	7	574	1842
<b>Total</b>	<b>312</b>	<b>312</b>	<b>14512</b>	<b>14492</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>10088</b>	<b>10072</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>10838</b>	<b>10604</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.