

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 21 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\$4535 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.81%<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	501,5	891,7	373,5	261,2	309,3	31,4	209,0
15-35	689,4	591,3	303,6	401,7	65,2	65,2	222,5
36-60	968,9	78,4	66,6	820,0	11,8	148,9	0,0
61-90	63,3	512,8	503,7	0,0	9,1	63,3	0,0
91-180	5,6	187,2	181,6	1,5	5,6	4,1	0,0
>180	168,5	340,4	280,0	123,0	27,4	12,5	33,0
<b>Total</b>	<b>2397,2</b>	<b>2601,7</b>	<b>1708,9</b>	<b>1607,3</b>	<b>428,3</b>	<b>325,4</b>	<b>464,5</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	8.11%		7.46%	7.65%	7.64%
15-35	7.90%		8.07%	7.92%	7.96%
36-60	-		7.98%	7.85%	7.90%
61-90	-		8.02%	7.85%	7.88%
91-180	-		7.97%	7.50%	7.83%
>180	7.94%		7.97%	7.89%	7.95%
<b>Total</b>	<b>8.00%</b>		<b>7.72%</b>	<b>7.83%</b>	<b>7.81%</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>	30	288	8736	8964	37	167	6130	6260	8	145	6767	6409
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5108	4688	0	0	3446	2573	0	0	3610	2461
Otros <sup>c</sup>	288	30	1339	1506	167	37	1029	1755	145	8	574	1848
<b>Total</b>	<b>318</b>	<b>318</b>	<b>15183</b>	<b>15158</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>10605</b>	<b>10588</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>10951</b>	<b>10718</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.