

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 23 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\$4194 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.45%<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	731,3	640,3	99,5	368,3	206,1	28,3	334,7
15-35	966,6	1402,6	824,5	408,3	25,4	5,6	552,7
36-60	40,0	54,9	42,3	29,0	12,6	11,0	0,0
61-90	36,9	104,3	55,0	35,0	49,3	1,9	0,0
91-180	151,4	95,3	1,6	75,0	23,2	5,9	70,5
>180	879,7	714,3	25,0	25,0	23,3	188,7	666,0
<b>Total</b>	<b>2805,9</b>	<b>3011,7</b>	<b>1047,8</b>	<b>940,6</b>	<b>340,0</b>	<b>241,4</b>	<b>1623,9</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	8.24%		4.89%	6.66%	6.69%
15-35	7.85%		7.48%	7.85%	7.68%
36-60	-		7.81%	7.80%	7.81%
61-90	-		8.00%	7.73%	7.93%
91-180	7.84%		8.07%	7.10%	7.52%
>180	7.85%		7.86%	7.75%	7.83%
<b>Total</b>	<b>7.93%</b>		<b>6.81%</b>	<b>7.28%</b>	<b>7.45%</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	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>	14	173	5634	5598	40	171	6617	6968	12	145	7335	6890
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3353	3241	0	0	3712	2918	0	0	3775	2692
Otros <sup>c</sup>	173	14	466	596	171	40	1354	1781	145	12	590	1884
<b>Total</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>9453</b>	<b>9435</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>11683</b>	<b>11667</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>11700</b>	<b>11466</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.