

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2023**  
**Fecha de Información: 24 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\$4316 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.19%<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	1193,3	743,5	130,6	543,9	144,9	181,5	468,0
15-35	1063,3	1564,0	619,5	305,2	218,0	31,5	726,5
36-60	58,5	42,3	25,0	0,0	10,0	51,2	7,3
61-90	19,8	28,9	0,0	0,0	28,9	19,8	0,0
91-180	396,4	507,9	35,0	0,0	82,4	5,9	390,5
>180	247,8	278,8	35,0	0,0	7,3	11,3	236,5
<b>Total</b>	<b>2979,1</b>	<b>3165,5</b>	<b>845,1</b>	<b>849,1</b>	<b>491,6</b>	<b>301,1</b>	<b>1828,8</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	8.07%		7.02%	4.31%	6.23%
15-35	7.79%		7.21%	7.70%	7.54%
36-60	7.73%		8.20%	7.78%	7.84%
61-90	-		7.97%	7.74%	7.88%
91-180	7.87%		7.92%	7.70%	7.88%
>180	7.82%		7.89%	7.39%	7.81%
<b>Total</b>	<b>7.88%</b>		<b>7.29%</b>	<b>5.63%</b>	<b>7.19%</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>	8	102	2724	2728	45	172	7056	7239	20	146	7807	7219
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1712	1740	0	0	3796	3093	0	0	3780	2891
Otros <sup>c</sup>	102	8	295	250	172	45	1445	1949	146	20	642	1885
<b>Total</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4731</b>	<b>4718</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>12297</b>	<b>12281</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>12229</b>	<b>11995</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.