

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de marzo de 2023**  
**Fecha de Información: 27 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\$3708 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.13%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	682,5	805,8	66,0	455,7	603,0	90,1	136,8
15-35	655,4	1059,8	711,8	350,3	155,0	112,1	193,0
36-60	173,0	109,5	50,0	25,0	59,5	148,0	0,0
61-90	112,2	30,1	0,6	0,0	29,6	112,2	0,0
91-180	185,4	92,0	45,0	0,0	36,5	174,9	10,5
>180	115,5	41,9	10,0	0,0	16,9	100,5	15,0
<b>Total</b>	<b>1924,1</b>	<b>2139,0</b>	<b>883,3</b>	<b>831,0</b>	<b>900,4</b>	<b>737,9</b>	<b>355,3</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	7.97%		5.87%	5.82%	6.07%
15-35	8.04%		7.63%	7.93%	7.76%
36-60	-		8.01%	7.83%	7.90%
61-90	-		8.04%	7.85%	7.89%
91-180	8.01%		8.11%	7.69%	7.83%
>180	7.87%		8.19%	7.81%	7.86%
<b>Total</b>	<b>8.01%</b>		<b>7.02%</b>	<b>7.05%</b>	<b>7.13%</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

Sector	27 feb. - 03 mar.				06 - 10 mar.				13 - 17 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	45	171	7496	7733	20	153	7922	7530	48	197	7621	9523
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3852	3267	0	0	3787	2984	0	10	5778	2908
Otros <sup>c</sup>	171	45	1734	2066	153	20	946	1905	197	38	610	1552
<b>Total</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>13082</b>	<b>13066</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>12655</b>	<b>12419</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>14009</b>	<b>13983</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.