

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2023**  
**Fecha de Información: 13 de marzo 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\$3533 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.92%<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	319,8	478,7	256,0	182,4	0,0	37,4	100
15-35	977,0	1054,2	595,2	522,6	27,1	22,4	432
36-60	162,8	137,1	44,0	79,3	13,1	3,5	80
61-90	94,6	3,3	0,0	0,0	3,3	94,6	0
91-180	292,1	337,4	113,9	153,0	84,5	0,1	139
>180	111,1	396,0	315,0	30,0	1,0	1,1	80
<b>Total</b>	<b>1957,4</b>	<b>2406,6</b>	<b>1324,1</b>	<b>967,2</b>	<b>128,9</b>	<b>159,2</b>	<b>831</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	8.08%		7.98%	7.69%	7.94%
15-35	7.96%		8.01%	7.85%	7.95%
36-60	7.93%		8.06%	7.75%	7.91%
61-90	-		8.10%	7.83%	7.84%
91-180	7.84%		7.90%	7.92%	7.88%
>180	7.75%		7.79%	7.77%	7.78%
<b>Total</b>	<b>7.93%</b>		<b>7.96%</b>	<b>7.82%</b>	<b>7.92%</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	13 – 17 mar.				20 - 24 mar.				27 - 31 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	72	211	12326	13953	32	158	5727	5188	35	189	5208	6113
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	10	8004	6115	0	0	2190	1779	0	0	3922	2132
Otros <sup>c</sup>	211	62	1679	1912	158	32	692	1632	189	35	700	1531
<b>Total</b>	<b>283</b>	<b>283</b>	<b>22009</b>	<b>21980</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>8609</b>	<b>8599</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>9830</b>	<b>9776</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.