

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2023**  
**Fecha de Información: 14 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\$4164 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.77%<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	964,0	945,1	201,7	547,8	347,9	20,7	395,5
15-35	890,7	1277,2	768,6	261,8	28,0	148,4	480,5
36-60	84,1	102,2	0,9	10,0	31,3	4,1	70,0
61-90	284,0	26,2	0,0	0,0	26,2	284,0	0,0
91-180	74,5	37,9	9,7	46,0	19,4	19,7	8,8
>180	184,0	288,9	221,8	144,0	27,1	0,0	40,0
<b>Total</b>	<b>2481,3</b>	<b>2677,5</b>	<b>1202,7</b>	<b>1009,6</b>	<b>479,9</b>	<b>476,9</b>	<b>994,8</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	8.00%		7.67%	7.07%	7.58%
15-35	7.98%		7.95%	7.85%	7.94%
36-60	7.97%		8.67%	7.82%	8.14%
61-90	-		8.53%	7.84%	7.90%
91-180	7.91%		8.02%	7.88%	7.91%
>180	7.67%		7.55%	7.62%	7.59%
<b>Total</b>	<b>7.98%</b>		<b>7.81%</b>	<b>7.56%</b>	<b>7.77%</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	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>	47	173	7757	8985	32	160	6017	5720	36	199	5294	6190
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	10	5306	3897	0	0	2257	1873	0	0	3941	2160
Otros <sup>c</sup>	173	37	1256	1430	160	32	977	1643	199	36	705	1536
<b>Total</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>14319</b>	<b>14312</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>9251</b>	<b>9236</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>9940</b>	<b>9886</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.