

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2023**  
**Fecha de Información: 17 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\$2153 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.56%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

| Rango        | Sector Financiero <sup>b</sup> |               | Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup> |              | Otros Agentes |              | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
|              | Compras                        | Ventas        | Compras                             | Ventas       | Compras       | Ventas       |                                      |
| 3-14         | 264,8                          | 309,2         | 50,5                                | 158,2        | 175,8         | 23,8         | 82,9                                 |
| 15-35        | 472,4                          | 697,3         | 466,8                               | 162,5        | 13,0          | 92,4         | 217,5                                |
| 36-60        | 6,7                            | 14,9          | 0,0                                 | 1,0          | 14,9          | 5,7          | 0,0                                  |
| 61-90        | 233,1                          | 142,7         | 30,0                                | 11,0         | 12,7          | 122,1        | 100,0                                |
| 91-180       | 277,9                          | 194,1         | 45,0                                | 123,4        | 19,1          | 24,5         | 130,0                                |
| >180         | 35,4                           | 35,3          | 20,0                                | 10,0         | 15,3          | 25,4         | 0,0                                  |
| <b>Total</b> | <b>1290,3</b>                  | <b>1393,4</b> | <b>612,3</b>                        | <b>466,1</b> | <b>250,8</b>  | <b>293,8</b> | <b>530,4</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         | 8.30%   |  | 7.97%                        | 5.41%        | 7.25%        |
| 15-35        | 8.19%   |  | 7.50%                        | 6.79%        | 7.51%        |
| 36-60        | -   |  | 8.04%                        | 7.96%        | 8.02%        |
| 61-90        | 8.01%   |  | 7.91%                        | 7.92%        | 7.96%        |
| 91-180       | 7.88%   |  | 7.98%                        | 7.80%        | 7.88%        |
| >180         | -   |  | 7.87%                        | 7.41%        | 7.64%        |
| <b>Total</b> | <b>8.10%</b>                                      |  | <b>7.73%</b>                 | <b>6.85%</b> | <b>7.56%</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>      | 23           | 67        | 2926        | 2980        | 38           | 163        | 6821         | 7021         | 45           | 202        | 5441         | 6420         |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 10        | 1234        | 1201        | 0            | 0          | 2636         | 2288         | 0            | 0          | 4058         | 2189         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 67           | 13        | 661         | 636         | 163          | 38         | 1605         | 1739         | 202          | 45         | 741          | 1576         |
| <b>Total</b>                        | <b>90</b>    | <b>90</b> | <b>4821</b> | <b>4817</b> | <b>201</b>   | <b>201</b> | <b>11062</b> | <b>11048</b> | <b>247</b>   | <b>247</b> | <b>10240</b> | <b>10185</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.