

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2023**  
**Fecha de Información: 28 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\$4209 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.41%<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	1048,5	621,0	132,9	768,9	360,2	0,0	279,7
15-35	893,0	1249,2	701,6	573,7	258,6	30,4	289,0
36-60	571,2	70,8	3,9	0,0	21,9	526,2	45,0
61-90	10,0	30,9	0,0	1,5	30,9	8,5	0,0
91-180	89,7	87,0	10,8	5,1	51,2	59,6	25,0
>180	38,3	147,5	112,3	16,0	25,1	12,4	10,0
<b>Total</b>	<b>2650,8</b>	<b>2206,5</b>	<b>961,6</b>	<b>1365,1</b>	<b>748,0</b>	<b>637,0</b>	<b>648,7</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	7.98%		5.99%	6.61%	6.52%
15-35	7.91%		7.93%	7.83%	7.89%
36-60	7.81%		8.18%	7.73%	7.75%
61-90	-		8.13%	7.86%	8.07%
91-180	7.77%		7.98%	7.75%	7.85%
>180	7.74%		7.72%	7.62%	7.70%
<b>Total</b>	<b>7.91%</b>		<b>7.26%</b>	<b>7.38%</b>	<b>7.41%</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	27 – 31 mar.				03 - 07 abr.				10 - 14 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	47	177	7204	8245	40	92	6106	6364	21	167	8211	8929
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4528	3326	0	0	3118	2718	0	0	4581	2955
Otros <sup>c</sup>	177	47	1622	1729	92	40	262	393	167	21	668	1561
<b>Total</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>13354</b>	<b>13300</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>9486</b>	<b>9475</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>13460</b>	<b>13445</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.