

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de abril de 2023**  
**Fecha de Información: 31 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\$3718 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.66%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	358,3	715,4	204,1	110,8	0,0	85,1	162,5
15-35	1072,1	822,7	508,0	736,1	35,3	0,0	336,1
36-60	9,6	14,1	0,0	0,0	14,0	9,6	0,0
61-90	391,1	82,3	5,0	35,0	77,3	356,1	0,0
91-180	34,3	48,0	0,0	10,0	28,0	4,3	20,0
>180	181,9	556,8	501,4	127,0	5,4	4,9	50,0
<b>Total</b>	<b>2047,2</b>	<b>2239,3</b>	<b>1218,6</b>	<b>1018,8</b>	<b>159,9</b>	<b>459,9</b>	<b>568,5</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	7.77%	4.73%	Inf%	5.98%
15-35	7.78%	7.34%	5.47%	6.51%
36-60	–	8.01%	7.45%	7.78%
61-90	–	7.93%	7.36%	7.46%
91-180	7.71%	8.01%	7.72%	7.85%
>180	7.63%	7.05%	7.21%	7.11%
<b>Total</b>	<b>7.76%</b>	<b>6.55%</b>	<b>6.34%</b>	<b>6.66%</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	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>	16	24	2066	2070	42	102	6496	6846	29	179	8950	10065
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1172	1133	0	0	3210	2968	0	0	4899	3365
Otros <sup>c</sup>	24	16	497	532	102	42	518	399	179	29	1250	1652
<b>Total</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>3735</b>	<b>3735</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>10224</b>	<b>10213</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>15099</b>	<b>15082</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.