

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de abril de 2023**  
**Fecha de Información: 05 de abril 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\$3426 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.15%<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	886,4	738,4	569,3	830,8	119,6	6,2	49,5
15-35	535,0	971,9	659,6	214,4	91,8	100,0	220,5
36-60	115,0	172,4	20,0	34,0	72,4	1,0	80,0
61-90	58,3	84,4	38,2	50,0	46,2	8,3	0,0
91-180	35,3	60,9	2,7	30,0	58,2	5,3	0,0
>180	93,5	57,1	10,5	60,0	13,6	0,5	33,0
<b>Total</b>	<b>1723,5</b>	<b>2085,1</b>	<b>1300,3</b>	<b>1219,2</b>	<b>401,8</b>	<b>121,2</b>	<b>383,0</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	8.15%		7.03%	5.43%	6.22%
15-35	8.22%		7.52%	8.07%	7.81%
36-60	7.91%		8.03%	8.07%	7.98%
61-90	-		8.07%	7.97%	8.03%
91-180	-		8.03%	7.81%	7.99%
>180	7.73%		7.76%	7.68%	7.74%
<b>Total</b>	<b>8.11%</b>		<b>7.43%</b>	<b>6.40%</b>	<b>7.15%</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	03 – 07 abr.				10 - 14 abr.				17 - 21 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	23	50	914	833	34	195	10821	11566	23	197	5053	6671
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	480	584	0	0	5609	4691	0	0	4216	2142
Otros <sup>c</sup>	50	23	119	91	195	34	1551	1706	197	23	426	868
<b>Total</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>1513</b>	<b>1508</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>17981</b>	<b>17963</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>9695</b>	<b>9681</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.