

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de abril de 2023**  
**Fecha de Información: 17 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\$4048 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.31%<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	473,1	748,5	211,8	289,9	374,8	21,2	162,0
15-35	1086,7	1022,0	633,7	721,7	47,8	24,5	340,5
36-60	418,2	45,6	10,0	51,1	35,6	367,1	0,0
61-90	0,2	62,0	35,0	0,0	27,0	0,2	0,0
91-180	116,8	260,9	178,0	66,0	32,9	0,8	50,0
>180	50,9	335,7	291,5	30,9	24,2	0,0	20,0
<b>Total</b>	<b>2145,9</b>	<b>2474,8</b>	<b>1360,0</b>	<b>1159,6</b>	<b>542,3</b>	<b>413,9</b>	<b>572,5</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	8.48%		5.35%	6.42%	6.23%
15-35	8.40%		7.76%	7.33%	7.83%
36-60	-		8.31%	7.62%	7.67%
61-90	-		8.03%	8.11%	8.03%
91-180	8.00%		8.10%	7.89%	8.04%
>180	7.90%		7.88%	7.72%	7.85%
<b>Total</b>	<b>8.37%</b>		<b>6.92%</b>	<b>7.22%</b>	<b>7.31%</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	17 – 21 abr.				24 - 28 abr.				01 - 05 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	35	216	7134	8346	37	321	8654	10034	20	104	4478	2872
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4682	3306	0	0	5811	4865	0	0	1553	2352
Otros <sup>c</sup>	216	35	959	1107	321	37	1273	820	104	20	363	1157
<b>Total</b>	<b>251</b>	<b>251</b>	<b>12775</b>	<b>12759</b>	<b>358</b>	<b>358</b>	<b>15738</b>	<b>15719</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>6394</b>	<b>6381</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.