

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de abril de 2023**  
**Fecha de Información: 20 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\$3166 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.23%<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	661,0	387,5	287,5	576,1	29,7	14,7	70,2
15-35	1114,8	1199,5	705,6	585,3	16,4	52,0	477,5
36-60	12,0	60,8	0,0	7,9	60,8	4,1	0,0
61-90	55,5	110,3	70,0	35,0	20,3	0,5	20,0
91-180	0,1	36,6	0,0	0,0	36,6	0,1	0,0
>180	16,9	78,8	61,7	12,4	17,1	4,5	0,0
<b>Total</b>	<b>1860,3</b>	<b>1873,5</b>	<b>1124,8</b>	<b>1216,7</b>	<b>180,9</b>	<b>75,9</b>	<b>567,7</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	8.88%		7.73%	8.40%	8.31%
15-35	8.97%		8.18%	6.98%	8.15%
36-60	-		9.30%	7.78%	9.21%
61-90	8.31%		8.29%	8.41%	8.32%
91-180	-		8.04%	7.95%	8.04%
>180	-		7.89%	7.75%	7.86%
<b>Total</b>	<b>8.93%</b>		<b>8.17%</b>	<b>7.86%</b>	<b>8.23%</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>	13	106	4742	4717	42	333	9842	11012	21	106	4607	3721
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2904	2834	0	0	6492	5751	0	0	2287	2354
Otros <sup>c</sup>	106	13	288	376	333	42	1309	861	106	21	383	1185
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>7934</b>	<b>7927</b>	<b>375</b>	<b>375</b>	<b>17643</b>	<b>17624</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>7277</b>	<b>7260</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.