

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de abril de 2023**  
**Fecha de Información: 24 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\$5847 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.59%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1091,8	1129,2	254,5	723,6	584,7	78,2	290
15-35	1288,9	959,1	734,1	1081,4	25,0	7,5	200
36-60	520,5	43,1	0,0	46,5	28,1	459,0	15
61-90	22,3	22,1	0,0	15,0	17,1	2,3	5
91-180	126,8	696,4	633,3	100,0	38,2	1,8	25
>180	162,3	386,5	286,9	95,2	32,6	0,1	67
<b>Total</b>	<b>3212,6</b>	<b>3236,5</b>	<b>1908,7</b>	<b>2061,8</b>	<b>725,8</b>	<b>548,8</b>	<b>602</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	8.90%		6.31%	7.92%	7.35%
15-35	8.91%		7.37%	7.14%	7.63%
36-60	8.67%		8.80%	7.73%	7.82%
61-90	8.29%		8.54%	8.48%	8.48%
91-180	8.23%		8.30%	8.22%	8.26%
>180	7.94%		8.01%	7.71%	7.95%
<b>Total</b>	<b>8.76%</b>		<b>6.98%</b>	<b>7.73%</b>	<b>7.59%</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	24 – 28 abr.				01 - 05 may.				08 - 12 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	44	340	10852	11582	27	107	5266	4759	18	158	6664	6676
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	6675	6300	0	0	2498	2741	0	0	3718	2812
Otros <sup>c</sup>	340	44	1338	964	107	27	974	1220	158	18	454	1338
<b>Total</b>	<b>384</b>	<b>384</b>	<b>18865</b>	<b>18846</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>8738</b>	<b>8720</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>10836</b>	<b>10826</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.