

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de abril de 2023**  
**Fecha de Información: 25 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\$2132 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.46%<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	343,6	552,8	333,3	193,3	101,3	32,1	118,2
15-35	518,7	481,8	340,1	337,8	25,5	64,7	116,2
36-60	65,8	46,2	34,6	60,0	6,6	0,8	5,0
61-90	201,8	11,9	0,0	200,0	11,9	1,8	0,0
91-180	48,1	51,5	0,0	47,2	51,5	0,8	0,0
>180	32,0	22,2	6,8	19,0	10,4	8,1	5,0
<b>Total</b>	<b>1209,9</b>	<b>1166,4</b>	<b>714,8</b>	<b>857,3</b>	<b>207,2</b>	<b>108,2</b>	<b>244,4</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	8.55%		8.54%	7.87%	8.34%
15-35	8.92%		5.74%	6.66%	6.73%
36-60	8.49%		6.86%	7.66%	7.46%
61-90	-		8.60%	8.19%	8.55%
91-180	-		8.35%	8.13%	8.34%
>180	7.83%		8.12%	7.51%	7.72%
<b>Total</b>	<b>8.71%</b>		<b>7.27%</b>	<b>7.11%</b>	<b>7.46%</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	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>	39	310	9595	10159	30	108	5485	4956	18	157	6737	6973
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5597	5181	0	0	2598	2841	0	0	3918	2838
Otros <sup>c</sup>	310	39	1277	1112	108	30	1006	1274	157	18	514	1347
<b>Total</b>	<b>349</b>	<b>349</b>	<b>16469</b>	<b>16452</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>9089</b>	<b>9071</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>11169</b>	<b>11158</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.