

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de mayo de 2023**  
**Fecha de Información: 28 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\$2819 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.92%<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	250,2	409,2	287,9	122,1	23,3	30,1	98
15-35	1115,3	1139,3	545,5	415,4	51,7	157,9	542
36-60	45,6	28,3	5,2	0,0	13,2	35,6	10
61-90	57,9	181,7	155,3	42,7	16,4	5,2	10
91-180	176,4	102,2	42,4	133,8	19,7	2,6	40
>180	6,7	6,4	1,0	0,0	5,4	6,7	0
<b>Total</b>	<b>1652,2</b>	<b>1867,2</b>	<b>1037,3</b>	<b>714,1</b>	<b>129,9</b>	<b>238,1</b>	<b>700</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	8.73%		10.14%	7.61%	9.29%
15-35	9.13%		8.96%	8.68%	8.95%
36-60	8.90%		8.65%	8.46%	8.58%
61-90	8.46%		8.48%	7.94%	8.39%
91-180	8.13%		8.32%	8.10%	8.15%
>180	-		8.76%	6.07%	7.27%
<b>Total</b>	<b>9.00%</b>		<b>9.24%</b>	<b>8.49%</b>	<b>8.92%</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>	10	79	1776	1739	42	117	5949	5436	31	156	6986	7287
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1140	1270	0	0	2848	3072	0	0	4076	2942
Otros <sup>c</sup>	79	10	279	185	117	42	1020	1291	156	31	574	1388
<b>Total</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>3195</b>	<b>3194</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>9817</b>	<b>9799</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>11636</b>	<b>11617</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.