

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de mayo de 2023**  
**Fecha de Información: 02 de mayo 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\$2436 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.71%<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	253,6	288,0	126,0	170,9	95,2	15,9	66,7
15-35	877,3	853,5	387,4	431,9	50,3	29,6	415,8
36-60	109,9	88,8	83,2	102,0	5,6	7,9	0,0
61-90	10,8	2,4	0,0	3,1	2,4	7,7	0,0
91-180	23,6	94,7	64,2	11,0	30,4	12,6	0,0
>180	92,7	222,8	167,7	23,2	55,1	69,5	0,0
<b>Total</b>	<b>1367,9</b>	<b>1550,3</b>	<b>828,6</b>	<b>742,1</b>	<b>239,1</b>	<b>143,2</b>	<b>482,5</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	8.96%		8.73%	8.75%	8.79%
15-35	8.93%		9.06%	8.81%	8.93%
36-60	-		8.77%	8.60%	8.61%
61-90	-		8.61%	8.28%	8.36%
91-180	-		8.29%	7.94%	8.19%
>180	-		7.90%	7.69%	7.83%
<b>Total</b>	<b>8.94%</b>		<b>8.62%</b>	<b>8.59%</b>	<b>8.71%</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	01 – 05 may.				08 - 12 may.				15 - 19 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	45	118	6083	5517	34	156	7095	7485	24	228	7525	7731
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2877	3154	0	0	4169	3036	0	0	5238	4126
Otros <sup>c</sup>	118	45	1023	1295	156	34	666	1391	228	24	508	1403
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>9983</b>	<b>9966</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>11930</b>	<b>11912</b>	<b>252</b>	<b>252</b>	<b>13271</b>	<b>13260</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.