

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de mayo de 2023**  
**Fecha de Información: 04 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\$2017 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.28%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	488,1	486,4	224,7	184,5	30,6	72,5	231,1
15-35	497,2	551,2	289,2	232,0	15,4	18,6	246,6
36-60	9,2	83,1	60,8	0,0	22,3	9,2	0,0
61-90	54,0	32,0	0,5	50,5	31,5	3,5	0,0
91-180	52,6	163,7	110,0	36,5	38,7	1,1	15,0
>180	69,1	63,0	21,7	25,5	1,3	3,7	40,0
<b>Total</b>	<b>1170,2</b>	<b>1379,4</b>	<b>706,9</b>	<b>529,0</b>	<b>139,8</b>	<b>108,5</b>	<b>532,7</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	9.17%	13.79%	13.22%	11.97%
15-35	9.11%	9.16%	9.00%	9.10%
36-60	–	9.04%	8.80%	9.01%
61-90	–	8.62%	8.39%	8.59%
91-180	8.34%	8.52%	8.10%	8.47%
>180	8.08%	8.19%	7.58%	8.04%
<b>Total</b>	<b>9.04%</b>	<b>10.60%</b>	<b>11.43%</b>	<b>10.28%</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>	17	82	1916	1607	39	163	7770	8417	27	220	7885	8070
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	573	875	0	0	4330	3359	0	0	5383	4255
Otros <sup>c</sup>	82	17	234	227	163	39	1113	1418	220	27	514	1446
<b>Total</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>2723</b>	<b>2709</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>13213</b>	<b>13194</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>13782</b>	<b>13771</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.