

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de julio de 2023**  
**Fecha de Información: 10 de julio 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\$3358 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.42%<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	436,8	963,4	361,7	372,8	550,2	12,5	51,5
15-35	661,1	526,0	314,8	449,0	17,1	18,0	194,1
36-60	504,4	25,3	0,0	66,0	15,3	428,4	10,0
61-90	12,1	3,1	0,0	0,0	3,1	12,1	0,0
91-180	167,7	213,6	177,7	25,0	15,9	122,7	20,0
>180	41,8	88,5	72,5	29,7	6,0	2,1	10,0
<b>Total</b>	<b>1824,0</b>	<b>1819,9</b>	<b>926,7</b>	<b>942,5</b>	<b>607,6</b>	<b>595,9</b>	<b>285,6</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	11.02%		5.29%	10.37%	6.69%
15-35	9.90%		11.01%	10.01%	10.19%
36-60	10.02%		11.13%	9.19%	9.27%
61-90	-		10.08%	9.68%	9.76%
91-180	9.22%		8.70%	9.19%	8.93%
>180	8.40%		7.89%	6.65%	7.83%
<b>Total</b>	<b>10.00%</b>		<b>6.72%</b>	<b>9.64%</b>	<b>8.42%</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	10 – 14 jul.				17 - 21 jul.				24 - 28 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	99	254	7441	7680	27	228	6048	7347	116	313	7787	6501
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3609	3266	0	0	4756	2831	0	0	3215	3506
Otros <sup>c</sup>	254	99	1450	1547	228	27	947	1567	313	116	835	1824
<b>Total</b>	<b>353</b>	<b>353</b>	<b>12500</b>	<b>12493</b>	<b>255</b>	<b>255</b>	<b>11751</b>	<b>11745</b>	<b>429</b>	<b>429</b>	<b>11837</b>	<b>11831</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.