

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2023**  
**Fecha de Información: 10 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\$2342 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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	681,5	751,2	408,9	477,1	148,2	10,4	194,1
15-35	403,5	480,6	245,2	96,1	16,3	88,4	219,0
36-60	173,9	78,2	0,0	7,0	6,2	94,9	72,0
61-90	92,5	38,8	0,0	49,0	7,3	12,0	31,5
91-180	27,3	43,5	2,5	5,0	23,0	4,3	18,0
>180	83,5	82,6	22,5	22,4	0,1	1,1	60,0
<b>Total</b>	<b>1462,2</b>	<b>1474,8</b>	<b>679,2</b>	<b>656,5</b>	<b>201,0</b>	<b>211,1</b>	<b>594,6</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	8.92%	8.04%	7.82%	8.17%
15-35	8.85%	8.87%	8.68%	8.82%
36-60	8.78%	8.61%	8.52%	8.63%
61-90	8.30%	8.42%	8.23%	8.29%
91-180	8.20%	8.27%	8.16%	8.23%
>180	7.97%	8.01%	7.88%	7.96%
<b>Total</b>	<b>8.73%</b>	<b>8.34%</b>	<b>8.16%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	08 – 12 may.				15 - 19 may.				22 - 26 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	32	120	4938	4941	28	222	9191	9997	32	271	5543	5128
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2883	2922	0	0	5934	4936	0	0	2622	2082
Otros <sup>c</sup>	120	32	386	332	222	28	1285	1461	271	29	504	1437
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>8207</b>	<b>8195</b>	<b>250</b>	<b>250</b>	<b>16410</b>	<b>16394</b>	<b>303</b>	<b>300</b>	<b>8669</b>	<b>8647</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.