

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de junio de 2023**  
**Fecha de Información: 02 de junio 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\$5091 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.23%<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	992,6	810,0	269,2	520,3	78,4	0,0	472,3
15-35	783,0	1123,5	490,6	497,0	449,5	102,6	183,4
36-60	411,1	163,6	135,0	0,0	28,6	411,1	0,0
61-90	318,2	118,4	31,3	237,0	17,1	11,2	70,0
91-180	310,7	461,0	155,0	60,0	59,8	4,5	246,2
>180	244,0	346,4	259,6	172,8	66,8	51,2	20,0
<b>Total</b>	<b>3059,5</b>	<b>3023,0</b>	<b>1340,8</b>	<b>1487,1</b>	<b>700,2</b>	<b>580,5</b>	<b>991,9</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	10.33%		9.94%	9.78%	10.06%
15-35	10.31%		9.03%	9.15%	9.23%
36-60	-		9.72%	8.22%	8.52%
61-90	9.01%		9.58%	9.19%	9.13%
91-180	8.75%		8.77%	8.25%	8.75%
>180	7.92%		7.83%	7.53%	7.71%
<b>Total</b>	<b>9.79%</b>		<b>9.10%</b>	<b>8.94%</b>	<b>9.23%</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	29 may. - 02 jun.				05 - 09 jun.				12 - 16 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	4	35	594	491	96	186	7414	8208	110	226	9190	10067
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	242	314	0	0	4351	3751	0	0	4566	3414
Otros <sup>c</sup>	35	4	52	76	186	96	770	562	226	110	1160	1243
<b>Total</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>888</b>	<b>881</b>	<b>282</b>	<b>282</b>	<b>12535</b>	<b>12521</b>	<b>336</b>	<b>336</b>	<b>14916</b>	<b>14724</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.