

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de junio de 2023**  
**Fecha de Información: 05 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\$4027 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.80%<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	658,6	635,8	243,3	438,7	196,3	23,7	196,2
15-35	1105,6	600,9	334,1	848,0	36,8	27,6	230,0
36-60	170,4	577,6	485,0	5,0	62,6	135,4	30,0
61-90	2,2	49,8	30,0	0,0	19,8	2,2	0,0
91-180	195,7	149,1	68,1	174,0	61,0	1,7	20,0
>180	189,8	177,8	145,4	177,0	22,5	2,8	10,0
<b>Total</b>	<b>2322,3</b>	<b>2190,9</b>	<b>1305,8</b>	<b>1642,7</b>	<b>398,8</b>	<b>193,4</b>	<b>486,3</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	10.27%		9.90%	10.18%	10.09%
15-35	10.13%		10.62%	10.14%	10.30%
36-60	9.89%		9.97%	9.44%	9.64%
61-90	-		9.03%	9.04%	9.03%
91-180	8.62%		8.65%	8.54%	8.61%
>180	7.94%		7.93%	7.72%	7.83%
<b>Total</b>	<b>10.07%</b>		<b>9.75%</b>	<b>9.70%</b>	<b>9.80%</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	05 – 09 jun.				12 - 16 jun.				19 - 23 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	99	187	7917	8418	112	234	9506	10641	17	212	4510	4134
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4449	4100	0	0	4845	3607	0	0	1896	2163
Otros <sup>c</sup>	187	99	775	608	234	112	1343	1254	212	17	838	937
<b>Total</b>	<b>286</b>	<b>286</b>	<b>13141</b>	<b>13126</b>	<b>346</b>	<b>346</b>	<b>15694</b>	<b>15502</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>7244</b>	<b>7234</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.