

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de junio de 2023**  
**Fecha de Información: 08 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\$4698 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.60%<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	996,4	632,1	350,8	814,0	112,7	13,8	168,6
15-35	891,5	770,4	546,9	720,0	77,4	25,4	146,1
36-60	82,0	137,9	85,3	50,0	22,6	2,0	30,0
61-90	273,3	94,1	77,9	211,0	16,1	62,3	0,0
91-180	36,2	540,8	500,0	30,7	40,8	5,5	0,0
>180	163,9	460,5	389,2	57,0	34,6	70,2	36,7
<b>Total</b>	<b>2443,4</b>	<b>2635,8</b>	<b>1950,1</b>	<b>1882,8</b>	<b>304,3</b>	<b>179,1</b>	<b>381,4</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	9.36%		9.19%	7.39%	8.35%
15-35	9.26%		8.91%	9.21%	9.04%
36-60	8.99%		8.47%	8.89%	8.61%
61-90	-		8.91%	8.62%	8.68%
91-180	-		8.35%	10.26%	8.48%
>180	7.80%		7.81%	7.66%	7.73%
<b>Total</b>	<b>9.14%</b>		<b>8.84%</b>	<b>8.05%</b>	<b>8.60%</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	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>	18	94	4398	4914	119	251	11079	11815	20	214	4969	5369
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3042	2506	0	0	5548	4817	0	0	2554	2252
Otros <sup>c</sup>	94	18	134	147	251	119	1470	1272	214	20	1062	954
<b>Total</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>7574</b>	<b>7567</b>	<b>370</b>	<b>370</b>	<b>18097</b>	<b>17904</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>8585</b>	<b>8575</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.