

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2023**  
**Fecha de Información: 11 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\$3494 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.24%<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	724,4	1159,3	647,8	451,0	282,2	44,1	229,3
15-35	661,6	685,5	397,7	375,6	39,6	37,8	248,2
36-60	56,8	14,4	0,8	0,0	13,6	56,8	0,0
61-90	238,0	203,7	183,5	0,0	10,2	228,0	10,0
91-180	15,0	45,6	38,0	12,7	7,6	2,3	0,0
>180	151,1	26,0	8,9	144,0	17,0	7,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1846,9</b>	<b>2134,4</b>	<b>1276,8</b>	<b>983,3</b>	<b>370,1</b>	<b>376,1</b>	<b>487,5</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	8.80%		7.76%	8.17%	8.04%
15-35	8.71%		8.80%	8.00%	8.52%
36-60	-		8.97%	8.52%	8.61%
61-90	8.22%		8.42%	8.25%	8.27%
91-180	-		8.06%	7.96%	8.04%
>180	-		7.99%	7.67%	7.90%
<b>Total</b>	<b>8.75%</b>		<b>8.08%</b>	<b>8.16%</b>	<b>8.24%</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>	21	87	3843	4126	29	222	9520	10437	33	272	5769	5562
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2608	2436	0	0	6068	5221	0	0	2936	2170
Otros <sup>c</sup>	87	21	219	102	222	29	1562	1475	272	30	506	1458
<b>Total</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>6670</b>	<b>6664</b>	<b>251</b>	<b>251</b>	<b>17150</b>	<b>17133</b>	<b>305</b>	<b>302</b>	<b>9211</b>	<b>9190</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.