

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2023**  
**Fecha de Información: 25 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\$2705 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.28%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	593,7	608,4	404,9	377,7	10,5	23,0	193,0
15-35	797,8	779,1	428,8	448,9	19,3	0,0	348,9
36-60	17,5	7,6	0,0	0,0	7,6	17,5	0,0
61-90	65,7	78,3	43,7	56,0	31,1	6,2	3,5
91-180	61,9	87,5	58,0	20,0	25,9	38,3	3,7
>180	66,3	135,9	69,7	15,0	20,7	5,8	45,5
<b>Total</b>	<b>1602,9</b>	<b>1696,9</b>	<b>1005,1</b>	<b>917,5</b>	<b>115,1</b>	<b>90,9</b>	<b>594,5</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	10.44%	8.29%	7.72%	8.84%
15-35	10.52%	8.61%	9.75%	9.55%
36-60	–	10.33%	10.08%	10.16%
61-90	9.52%	9.56%	9.82%	9.68%
91-180	8.85%	9.11%	9.12%	9.11%
>180	8.59%	8.59%	7.23%	8.51%
<b>Total</b>	<b>10.32%</b>	<b>8.64%</b>	<b>9.08%</b>	<b>9.28%</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	22 – 26 may.				29 may. - 02 jun.				05 - 09 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	13	197	4052	4234	204	295	6440	6743	81	166	5813	6318
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2036	2008	0	0	3027	2981	0	0	3766	3068
Otros <sup>c</sup>	197	13	370	203	295	204	1507	1239	166	81	329	522
<b>Total</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>6458</b>	<b>6445</b>	<b>499</b>	<b>499</b>	<b>10974</b>	<b>10963</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>9908</b>	<b>9908</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.