

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de junio de 2023**  
**Fecha de Información: 13 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\$2888 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.50%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	517,7	480,8	284,5	411,3	109,2	19,5	87
15-35	698,9	854,1	573,3	481,0	90,8	27,9	190
36-60	250,7	140,4	65,0	127,0	15,4	63,7	60
61-90	3,7	20,4	14,1	0,0	6,4	3,7	0
91-180	164,7	56,2	23,5	55,0	27,7	104,7	5
>180	15,8	26,3	20,0	13,0	6,3	2,8	0
<b>Total</b>	<b>1651,5</b>	<b>1578,2</b>	<b>980,4</b>	<b>1087,3</b>	<b>255,8</b>	<b>222,2</b>	<b>342</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	10.01%		9.07%	9.42%	9.38%
15-35	9.84%		9.88%	9.81%	9.85%
36-60	9.18%		9.44%	9.61%	9.49%
61-90	-		9.04%	7.33%	8.41%
91-180	8.67%		8.63%	8.43%	8.47%
>180	-		8.02%	6.86%	7.60%
<b>Total</b>	<b>9.75%</b>		<b>9.55%</b>	<b>9.36%</b>	<b>9.50%</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	12 – 16 jun.				19 - 23 jun.				26 - 30 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	131	264	12184	12718	21	215	5160	5686	16	238	7374	8068
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	6228	5631	0	0	2770	2344	0	0	3551	3220
Otros <sup>c</sup>	264	131	1577	1447	215	21	1089	979	238	16	1740	1376
<b>Total</b>	<b>395</b>	<b>395</b>	<b>19989</b>	<b>19796</b>	<b>236</b>	<b>236</b>	<b>9019</b>	<b>9009</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>12665</b>	<b>12664</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.