

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de junio de 2023**  
**Fecha de Información: 14 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\$5665 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.36%<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	776,7	844,3	619,4	560,3	34,9	26,4	190,0
15-35	714,3	1393,1	1094,6	388,2	23,5	51,0	275,0
36-60	56,6	12,5	0,0	49,8	12,3	6,5	0,2
61-90	480,0	25,8	0,0	449,7	10,8	15,3	15,0
91-180	254,1	767,7	598,7	129,0	48,7	4,8	120,3
>180	825,3	130,1	105,0	797,8	10,1	12,5	15,0
<b>Total</b>	<b>3106,9</b>	<b>3173,4</b>	<b>2417,7</b>	<b>2374,8</b>	<b>140,2</b>	<b>116,6</b>	<b>615,5</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	10.20%		9.55%	8.31%	9.08%
15-35	10.46%		10.10%	10.11%	10.22%
36-60	10.00%		9.99%	9.92%	9.94%
61-90	9.55%		9.30%	8.98%	9.27%
91-180	8.77%		8.78%	8.56%	8.74%
>180	7.47%		6.64%	7.45%	7.12%
<b>Total</b>	<b>9.95%</b>		<b>9.58%</b>	<b>8.71%</b>	<b>9.36%</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>	124	205	11031	11124	22	216	5360	6290	18	239	7607	8462
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5455	5132	0	0	3256	2425	0	0	3712	3220
Otros <sup>c</sup>	205	124	1298	1344	216	22	1093	984	239	18	1775	1412
<b>Total</b>	<b>329</b>	<b>329</b>	<b>17784</b>	<b>17600</b>	<b>238</b>	<b>238</b>	<b>9709</b>	<b>9699</b>	<b>257</b>	<b>257</b>	<b>13094</b>	<b>13094</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.