

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de junio de 2023**  
**Fecha de Información: 28 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\$1707 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.43%<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	509,1	200,6	51,0	236,7	17,6	140,4	132,0
15-35	395,4	715,6	379,5	154,8	128,9	33,4	207,2
36-60	21,3	15,0	0,0	8,0	15,0	13,3	0,0
61-90	6,7	10,0	0,0	5,0	10,0	1,7	0,0
91-180	0,4	23,0	5,0	0,0	18,0	0,4	0,0
>180	104,6	93,9	40,4	20,2	3,5	34,4	50,0
<b>Total</b>	<b>1037,6</b>	<b>1058,2</b>	<b>475,9</b>	<b>424,7</b>	<b>193,1</b>	<b>223,7</b>	<b>389,2</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	12.35%	11.28%	7.61%	9.12%
15-35	11.87%	11.73%	11.70%	11.76%
36-60	–	11.31%	10.58%	10.88%
61-90	–	10.32%	10.41%	10.36%
91-180	–	9.17%	8.96%	9.16%
>180	8.04%	8.40%	7.23%	7.87%
<b>Total</b>	<b>11.54%</b>	<b>11.31%</b>	<b>8.73%</b>	<b>10.43%</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	26 – 30 jun.				03 - 07 jul.				10 - 14 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	30	208	8529	9140	39	156	3784	4727	87	217	5874	5472
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4606	4141	0	0	3157	2093	0	0	3009	2459
Otros <sup>c</sup>	208	30	900	755	156	39	551	672	217	87	438	1387
<b>Total</b>	<b>238</b>	<b>238</b>	<b>14035</b>	<b>14036</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>7492</b>	<b>7492</b>	<b>304</b>	<b>304</b>	<b>9321</b>	<b>9318</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.