

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de julio de 2023**  
**Fecha de Información: 04 de julio 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\$107 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.31%<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	2,5	19,1	15,1	0,0	1,9	0,5	2
15-35	22,7	45,2	18,0	20,8	27,2	1,8	0
36-60	0,8	3,5	0,0	0,0	3,5	0,8	0
61-90	3,6	1,4	0,0	0,0	1,4	3,6	0
91-180	1,8	3,5	0,0	0,0	3,5	1,8	0
>180	1,8	2,5	0,0	0,0	2,5	1,8	0
<b>Total</b>	<b>33,3</b>	<b>75,2</b>	<b>33,1</b>	<b>20,8</b>	<b>40,1</b>	<b>10,5</b>	<b>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	13.89%	10.24%	8.73%	11.69%
15-35	–	12.30%	11.77%	12.23%
36-60	–	11.12%	8.59%	10.63%
61-90	–	10.64%	9.74%	9.99%
91-180	–	9.28%	8.88%	9.14%
>180	–	10.17%	5.94%	8.41%
<b>Total</b>	<b>13.89%</b>	<b>11.69%</b>	<b>9.73%</b>	<b>11.31%</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

Sector	03 – 07 jul.				10 - 14 jul.				17 - 21 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	47	167	4781	5600	88	224	6397	5840	23	220	5384	5716
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3601	2839	0	0	3103	2642	0	0	4038	2553
Otros <sup>c</sup>	167	47	736	679	224	88	449	1464	220	23	391	1538
<b>Total</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>9118</b>	<b>9118</b>	<b>312</b>	<b>312</b>	<b>9949</b>	<b>9946</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>9813</b>	<b>9807</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.