

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de julio de 2023**  
**Fecha de Información: 14 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\$2546 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.29%<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	388,7	468,8	275,2	269,8	98,6	23,9	95,0
15-35	607,0	731,9	584,5	463,5	15,0	11,1	132,4
36-60	161,8	117,3	80,0	0,0	37,1	161,7	0,1
61-90	25,7	62,7	30,0	10,0	17,7	0,7	15,0
91-180	9,9	78,1	20,0	0,0	49,1	0,9	9,0
>180	84,5	91,3	55,0	50,0	6,3	4,5	30,0
<b>Total</b>	<b>1277,7</b>	<b>1550,0</b>	<b>1044,7</b>	<b>793,3</b>	<b>223,8</b>	<b>202,9</b>	<b>281,5</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	10.81%		8.67%	8.06%	8.71%
15-35	11.04%		7.48%	6.04%	7.48%
36-60	10.30%		10.36%	10.49%	10.47%
61-90	10.35%		9.89%	9.55%	10.09%
91-180	9.58%		8.98%	8.90%	9.07%
>180	8.65%		7.68%	7.46%	7.85%
<b>Total</b>	<b>10.62%</b>		<b>8.11%</b>	<b>7.70%</b>	<b>8.29%</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	10 – 14 jul.				17 - 21 jul.				24 - 28 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	75	52	698	860	34	242	7125	8534	118	322	8225	7435
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	316	143	0	0	5230	3742	0	0	3839	3688
Otros <sup>c</sup>	52	75	59	69	242	34	1597	1670	322	118	961	1895
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>1073</b>	<b>1072</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>13952</b>	<b>13946</b>	<b>440</b>	<b>440</b>	<b>13025</b>	<b>13018</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.