

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de julio de 2023**  
**Fecha de Información: 19 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\$3952 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.18%<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	595,9	789,3	636,6	521,7	113,7	35,2	39,0
15-35	593,1	791,9	660,2	376,6	21,4	106,1	110,4
36-60	260,7	33,7	25,0	147,6	8,7	113,1	0,0
61-90	287,8	318,2	70,5	46,2	9,6	3,6	238,0
91-180	368,4	261,5	26,1	163,9	37,4	6,5	198,0
>180	136,7	110,0	76,2	109,7	23,7	17,0	10,0
<b>Total</b>	<b>2242,7</b>	<b>2304,6</b>	<b>1494,6</b>	<b>1365,9</b>	<b>214,5</b>	<b>281,5</b>	<b>595,4</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	12.59%	11.26%	10.22%	11.04%
15-35	12.83%	12.59%	12.70%	12.67%
36-60	–	11.82%	10.97%	11.03%
61-90	10.43%	10.55%	10.69%	10.46%
91-180	10.41%	9.69%	9.76%	10.23%
>180	7.66%	8.16%	7.98%	8.02%
<b>Total</b>	<b>10.96%</b>	<b>11.45%</b>	<b>11.00%</b>	<b>11.18%</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	17 – 21 jul.				24 - 28 jul.				31 jul. - 04 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	20	158	4212	4608	121	344	8892	9887	25	198	4768	6261
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3066	2624	0	0	4936	4214	0	0	4336	2779
Otros <sup>c</sup>	158	20	798	844	344	121	2210	1931	198	25	430	494
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>8076</b>	<b>8076</b>	<b>465</b>	<b>465</b>	<b>16038</b>	<b>16032</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>9534</b>	<b>9534</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.