

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de julio de 2023**  
**Fecha de Información: 21 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\$3735 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.72%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	406,7	633,2	379,0	265,7	157,2	43,9	97,0
15-35	878,6	673,6	353,4	564,3	57,3	51,3	263,0
36-60	158,1	320,5	308,9	46,1	11,6	112,0	0,0
61-90	14,8	327,0	307,0	0,0	10,0	4,8	10,0
91-180	377,7	53,0	20,4	354,0	32,6	0,0	23,7
>180	139,9	145,6	98,0	128,5	47,6	11,4	0,0
<b>Total</b>	<b>1975,7</b>	<b>2152,9</b>	<b>1466,7</b>	<b>1358,6</b>	<b>316,2</b>	<b>223,4</b>	<b>393,7</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	12.45%	12.66%	9.94%	11.82%
15-35	12.98%	12.48%	12.98%	12.77%
36-60	–	12.26%	11.90%	11.92%
61-90	11.46%	11.17%	10.70%	11.19%
91-180	–	9.79%	9.56%	9.64%
>180	–	8.27%	7.85%	8.06%
<b>Total</b>	<b>12.80%</b>	<b>11.98%</b>	<b>10.70%</b>	<b>11.72%</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>	9	59	1108	1188	123	349	9094	10406	25	200	4859	6370
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	798	700	0	0	5236	4336	0	0	4421	2818
Otros <sup>c</sup>	59	9	130	149	349	123	2359	1941	200	25	432	525
<b>Total</b>	<b>68</b>	<b>68</b>	<b>2036</b>	<b>2037</b>	<b>472</b>	<b>472</b>	<b>16689</b>	<b>16683</b>	<b>225</b>	<b>225</b>	<b>9712</b>	<b>9713</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.