

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 30 de agosto 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\$5223 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.08%<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	1012,3	1285,3	318,2	618,7	590,0	16,6	377,0
15-35	1546,9	977,3	648,9	344,0	115,1	989,7	213,3
36-60	255,5	5,4	1,8	0,0	3,6	255,5	0,0
61-90	198,4	68,5	45,8	162,5	12,7	25,9	10,0
91-180	6,0	203,6	179,9	5,6	23,6	0,4	0,0
>180	249,2	75,2	7,0	52,5	8,2	136,7	60,0
<b>Total</b>	<b>3268,3</b>	<b>2615,2</b>	<b>1201,7</b>	<b>1183,3</b>	<b>753,2</b>	<b>1424,7</b>	<b>660,3</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	11.48%	8.73%	8.53%	9.41%
15-35	11.52%	11.06%	10.77%	10.94%
36-60	–	10.54%	9.67%	9.68%
61-90	10.69%	10.31%	10.47%	10.47%
91-180	–	9.59%	9.65%	9.59%
>180	7.79%	-1.98%	8.66%	7.86%
<b>Total</b>	<b>11.15%</b>	<b>9.56%</b>	<b>10.06%</b>	<b>10.08%</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	28 ago. - 01 sep.				04 - 08 sep.				11 - 15 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	49	140	6187	6666	26	140	6858	7321	40	147	7160	8662
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3509	2840	0	0	3959	3550	0	0	5615	2289
Otros <sup>c</sup>	140	49	1516	1703	140	26	1570	1509	147	40	418	1664
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>11212</b>	<b>11209</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>12387</b>	<b>12380</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>13193</b>	<b>12615</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.