

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$4518 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.80%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	756,5	912,7	133,6	260,9	293,6	10,1	485,5
15-35	1479,1	1464,2	576,8	689,2	146,9	49,4	740,5
36-60	285,1	18,7	1,3	0,0	17,4	285,1	0,0
61-90	15,8	184,1	171,3	0,0	12,9	15,8	0,0
91-180	6,1	338,8	313,0	0,0	22,8	3,1	3,0
>180	231,8	135,3	34,0	144,8	20,3	6,1	81,0
<b>Total</b>	<b>2774,5</b>	<b>3053,8</b>	<b>1229,9</b>	<b>1094,9</b>	<b>513,9</b>	<b>369,6</b>	<b>1310,0</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	12.34%	11.97%	7.75%	11.84%
15-35	12.27%	12.22%	12.22%	12.24%
36-60	–	11.63%	11.94%	11.92%
61-90	–	10.88%	11.05%	10.96%
91-180	9.26%	9.95%	9.30%	9.80%
>180	8.11%	9.09%	8.20%	8.26%
<b>Total</b>	<b>12.03%</b>	<b>12.00%</b>	<b>11.10%</b>	<b>11.80%</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>	30	35	1178	1371	32	148	7323	7941	43	149	7985	9785
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	841	666	0	0	4076	3725	0	0	5751	2405
Otros <sup>c</sup>	35	30	74	54	148	32	1787	1514	149	43	703	1671
<b>Total</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>2093</b>	<b>2091</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>13186</b>	<b>13180</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>14439</b>	<b>13861</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.