

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 08 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\$4132 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.73%<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	1370,1	865,5	556,3	1197,2	158,7	22,4	150,5
15-35	562,0	1104,1	777,1	304,0	83,4	14,5	243,5
36-60	24,2	98,4	50,0	0,0	28,4	4,2	20,0
61-90	44,4	119,7	61,2	0,0	18,5	4,4	40,0
91-180	12,4	16,9	0,0	10,0	16,9	2,4	0,0
>180	302,4	75,9	55,8	149,0	10,2	143,3	10,0
<b>Total</b>	<b>2315,5</b>	<b>2280,5</b>	<b>1500,4</b>	<b>1660,2</b>	<b>316,1</b>	<b>191,3</b>	<b>464,0</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	12.58%		8.08%	10.13%	9.66%
15-35	12.47%		12.25%	12.33%	12.32%
36-60	12.42%		12.29%	11.76%	12.30%
61-90	11.51%		10.81%	10.79%	11.19%
91-180	-		10.05%	10.09%	10.06%
>180	8.17%		9.25%	8.91%	8.89%
<b>Total</b>	<b>12.33%</b>		<b>10.52%</b>	<b>10.23%</b>	<b>10.73%</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	04 – 08 sep.				11 - 15 sep.				18 - 22 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	16	30	429	407	72	167	9989	11703	20	217	6341	7562
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	250	260	0	0	6209	3884	0	0	4859	3231
Otros <sup>c</sup>	30	16	63	75	167	72	1653	1683	217	20	598	987
<b>Total</b>	<b>46</b>	<b>46</b>	<b>742</b>	<b>742</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>17851</b>	<b>17270</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>11798</b>	<b>11780</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.