

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 12 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\$4322 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.88%<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	985,6	1030,8	569,7	727,8	374,2	170,8	87,0
15-35	701,7	934,2	424,1	287,4	141,8	46,0	368,3
36-60	504,6	207,9	60,0	0,0	18,9	375,6	129,0
61-90	41,2	14,5	0,4	0,0	14,0	41,2	0,0
91-180	266,7	241,3	10,0	86,3	52,3	1,4	179,0
>180	114,1	77,6	28,0	78,0	14,6	1,1	35,0
<b>Total</b>	<b>2613,9</b>	<b>2506,3</b>	<b>1092,2</b>	<b>1179,5</b>	<b>615,9</b>	<b>636,2</b>	<b>798,3</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	11.65%		2.61%	6.10%	4.76%
15-35	11.68%		11.66%	11.77%	11.69%
36-60	10.72%		11.17%	9.39%	9.81%
61-90	-		10.80%	10.91%	10.88%
91-180	9.74%		9.76%	9.76%	9.74%
>180	8.92%		8.57%	5.32%	7.80%
<b>Total</b>	<b>10.96%</b>		<b>7.15%</b>	<b>8.91%</b>	<b>8.88%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	11 – 15 sep.				18 - 22 sep.				25 - 29 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	52	131	9893	10469	22	223	6613	8566	50	232	7739	8868
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5458	4283	0	0	5321	3397	0	0	4839	3084
Otros <sup>c</sup>	131	52	1523	1576	223	22	1070	998	232	50	1278	1882
<b>Total</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>16874</b>	<b>16328</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>13004</b>	<b>12961</b>	<b>282</b>	<b>282</b>	<b>13856</b>	<b>13834</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.