

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 15 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\$2532 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.47%<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	637,1	545,7	138,5	270,9	56,6	15,5	350,7
15-35	803,7	909,0	479,9	240,9	15,9	149,6	413,2
36-60	51,9	80,0	68,7	50,0	11,2	1,9	0,0
61-90	101,4	77,6	10,0	45,0	12,6	1,4	55,0
91-180	53,6	41,2	2,2	32,7	22,5	4,4	16,5
>180	47,3	34,7	15,0	30,0	3,7	1,3	16,0
<b>Total</b>	<b>1694,9</b>	<b>1688,1</b>	<b>714,3</b>	<b>669,5</b>	<b>122,4</b>	<b>174,0</b>	<b>851,4</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	11.57%	10.56%	11.50%	11.32%
15-35	11.52%	9.10%	9.69%	10.17%
36-60	–	10.34%	10.68%	10.35%
61-90	10.31%	10.28%	10.17%	10.25%
91-180	9.35%	9.71%	9.66%	9.60%
>180	7.82%	8.93%	7.97%	8.27%
<b>Total</b>	<b>11.35%</b>	<b>9.61%</b>	<b>10.13%</b>	<b>10.47%</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	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>	8	40	622	578	27	246	7522	9528	53	239	8188	9291
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	391	410	0	0	5857	3898	0	0	5015	3319
Otros <sup>c</sup>	40	8	65	82	246	27	1100	1010	239	53	1326	1899
<b>Total</b>	<b>48</b>	<b>48</b>	<b>1078</b>	<b>1070</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>14479</b>	<b>14436</b>	<b>292</b>	<b>292</b>	<b>14529</b>	<b>14509</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.