

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2023**  
**Fecha de Información: 18 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\$3173 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.74%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	589,4	1095,0	302,1	259,6	476,9	13,8	316,0
15-35	601,3	694,2	255,5	189,0	30,3	4,0	408,4
36-60	472,6	173,4	140,0	50,0	33,4	422,6	0,0
61-90	4,2	23,2	0,0	0,0	23,2	4,2	0,0
91-180	142,7	37,2	0,0	141,7	37,2	1,0	0,0
>180	51,2	31,7	0,0	30,0	12,6	2,1	19,1
<b>Total</b>	<b>1861,4</b>	<b>2054,7</b>	<b>697,6</b>	<b>670,3</b>	<b>613,6</b>	<b>447,7</b>	<b>743,4</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	11.58%		10.57%	9.77%	10.70%
15-35	11.48%		10.53%	11.43%	11.20%
36-60	—		10.91%	10.36%	10.40%
61-90	—		10.27%	9.63%	10.17%
91-180	—		9.47%	9.42%	9.47%
>180	8.48%		8.76%	7.47%	8.52%
<b>Total</b>	<b>11.45%</b>		<b>10.50%</b>	<b>10.38%</b>	<b>10.74%</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	18 - 22 sep.				25 - 29 sep.				02 - 06 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	27	252	7754	9586	55	242	8406	10157	45	95	5973	5975
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5901	4072	0	0	5273	3340	0	0	4018	2837
Otros <sup>c</sup>	252	27	1106	1059	242	55	1746	1908	95	45	584	1750
<b>Total</b>	<b>279</b>	<b>279</b>	<b>14761</b>	<b>14717</b>	<b>297</b>	<b>297</b>	<b>15425</b>	<b>15405</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>10575</b>	<b>10562</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.