

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 21 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\$2845 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.02%<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         | 859,8                          | 872,7         | 373,0                               | 565,9        | 220,4         | 14,6         | 279,3                                |
| 15-35        | 361,2                          | 596,4         | 357,8                               | 131,8        | 14,7          | 5,4          | 224,0                                |
| 36-60        | 172,9                          | 5,0           | 0,0                                 | 0,0          | 5,0           | 172,9        | 0,0                                  |
| 61-90        | 41,8                           | 45,4          | 26,7                                | 0,5          | 18,7          | 41,3         | 0,0                                  |
| 91-180       | 6,5                            | 157,8         | 134,2                               | 0,0          | 23,6          | 6,5          | 0,0                                  |
| >180         | 86,3                           | 157,3         | 140,5                               | 66,3         | 1,8           | 4,9          | 15,0                                 |
| <b>Total</b> | <b>1528,5</b>                  | <b>1834,6</b> | <b>1032,2</b>                       | <b>764,6</b> | <b>284,1</b>  | <b>245,6</b> | <b>518,3</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         | 10.43%  | 9.43%                        | 10.34%       | 9.94%         |
| 15-35        | 10.54%  | 10.56%                       | 10.31%       | 10.54%        |
| 36-60        | –   | 10.42%                       | 9.37%        | 9.40%         |
| 61-90        | –   | 9.91%                        | 9.51%        | 9.63%         |
| 91-180       | –   | 9.50%                        | 8.71%        | 9.33%         |
| >180         | 7.74%   | 8.42%                        | 7.83%        | 7.83%         |
| <b>Total</b> | <b>10.40%</b>                                     | <b>9.86%</b>                 | <b>9.77%</b> | <b>10.02%</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>      | 11           | 153        | 3685        | 3880        | 61           | 244        | 9473         | 11510        | 46           | 97         | 6359         | 6676         |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 2317        | 1998        | 1            | 0          | 5614         | 3889         | 0            | 0          | 4357         | 2880         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 152          | 11         | 284         | 403         | 243          | 61         | 2271         | 1939         | 97           | 46         | 668          | 1814         |
| <b>Total</b>                        | <b>163</b>   | <b>164</b> | <b>6286</b> | <b>6281</b> | <b>305</b>   | <b>305</b> | <b>17358</b> | <b>17338</b> | <b>143</b>   | <b>143</b> | <b>11384</b> | <b>11370</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.