

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 26 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\$4597 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.23%<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	924,1	1065,6	235,2	403,4	334,6	24,9	495,8
15-35	1150,9	1708,7	900,5	307,1	66,4	102,0	741,8
36-60	209,9	65,3	50,0	150,0	5,3	49,9	10,0
61-90	12,2	16,2	8,5	0,0	2,7	7,2	5,0
91-180	470,2	240,5	80,9	3,0	3,5	311,2	156,0
>180	79,8	62,3	61,0	70,0	1,3	9,8	0,0
<b>Total</b>	<b>2847,2</b>	<b>3158,6</b>	<b>1336,1</b>	<b>933,5</b>	<b>413,9</b>	<b>505,1</b>	<b>1408,6</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	11.09%	7.10%	11.13%	9.76%
15-35	11.08%	10.80%	10.79%	10.92%
36-60	10.34%	11.40%	10.87%	10.83%
61-90	9.94%	10.20%	9.21%	9.63%
91-180	9.28%	9.88%	8.98%	9.09%
>180	–	8.89%	8.08%	8.17%
<b>Total</b>	<b>10.87%</b>	<b>9.35%</b>	<b>10.29%</b>	<b>10.23%</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	25 – 29 sep.				02 - 06 oct.				09 - 13 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	60	196	9779	11567	90	99	6926	7834	88	132	6066	6308
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	5341	4012	0	0	4702	2996	0	0	4073	2344
Otros <sup>c</sup>	196	60	2451	1972	99	90	1038	1822	132	88	425	1377
<b>Total</b>	<b>257</b>	<b>256</b>	<b>17571</b>	<b>17551</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>12666</b>	<b>12652</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>10564</b>	<b>10029</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.