

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2023**  
**Fecha de Información: 11 de agosto 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\$3597 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.27%<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	785,0	882,4	646,1	590,8	70,7	28,6	165,6
15-35	746,4	942,1	627,7	401,8	48,8	79,1	265,6
36-60	2,7	37,6	31,7	0,0	6,0	2,7	0,0
61-90	130,2	66,2	45,0	112,0	11,2	8,2	10,0
91-180	172,3	64,4	35,0	151,1	9,4	1,2	20,0
>180	147,1	86,9	67,2	141,9	14,7	0,1	5,0
<b>Total</b>	<b>1983,6</b>	<b>2079,6</b>	<b>1452,7</b>	<b>1397,6</b>	<b>160,7</b>	<b>119,8</b>	<b>466,2</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	12.56%	10.23%	7.62%	9.74%
15-35	12.67%	12.65%	12.50%	12.61%
36-60	–	12.97%	13.47%	13.13%
61-90	12.06%	12.11%	10.57%	11.77%
91-180	11.71%	11.83%	11.85%	11.82%
>180	10.66%	9.79%	10.30%	10.13%
<b>Total</b>	<b>12.55%</b>	<b>11.43%</b>	<b>10.35%</b>	<b>11.27%</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	07 – 11 ago.				14 - 18 ago.				21 - 25 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	4	45	659	981	217	231	8434	9760	95	227	6813	6702
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	595	256	0	0	5928	4800	0	0	3855	3051
Otros <sup>c</sup>	45	4	88	105	231	217	1579	1364	227	95	569	1478
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>1342</b>	<b>1342</b>	<b>448</b>	<b>448</b>	<b>15941</b>	<b>15924</b>	<b>322</b>	<b>322</b>	<b>11237</b>	<b>11231</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.