

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2023**  
**Fecha de Información: 16 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\$4338 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 12.94%<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	1486,1	959,9	505,9	849,6	75,1	257,5	379,0
15-35	843,8	1150,8	765,0	402,3	17,5	73,2	368,3
36-60	95,3	197,6	58,3	50,0	99,4	5,3	40,0
61-90	13,2	44,4	34,7	0,0	9,7	13,2	0,0
91-180	81,7	120,9	10,0	19,4	75,9	27,3	35,0
>180	123,7	71,2	10,0	16,7	33,2	79,0	28,0
<b>Total</b>	<b>2643,7</b>	<b>2544,9</b>	<b>1383,8</b>	<b>1338,0</b>	<b>310,8</b>	<b>455,5</b>	<b>850,3</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	13.58%	13.46%	12.20%	12.80%
15-35	13.23%	13.80%	13.28%	13.54%
36-60	13.16%	13.01%	12.52%	12.91%
61-90	–	12.81%	12.34%	12.54%
91-180	11.75%	11.39%	11.45%	11.49%
>180	9.71%	9.67%	10.62%	10.18%
<b>Total</b>	<b>13.20%</b>	<b>13.37%</b>	<b>12.36%</b>	<b>12.94%</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	14 – 18 ago.				21 - 25 ago.				28 ago. - 01 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	35	160	6787	7219	115	233	7871	8929	63	265	6875	5477
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4455	3960	0	0	4679	3417	0	0	3271	3335
Otros <sup>c</sup>	160	35	1049	1095	233	115	1298	1496	265	63	674	2006
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>12291</b>	<b>12274</b>	<b>348</b>	<b>348</b>	<b>13848</b>	<b>13842</b>	<b>328</b>	<b>328</b>	<b>10820</b>	<b>10818</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.