

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2023**  
**Fecha de Información: 24 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\$5040 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.55%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	328,8	1009,1	322,8	102,5	488,4	28,3	198
15-35	1105,6	1542,9	817,8	375,4	8,2	13,2	717
36-60	466,2	15,2	0,0	55,0	15,2	411,2	0
61-90	275,2	185,0	110,6	210,0	14,3	5,2	60
91-180	59,8	243,5	197,3	15,0	10,2	8,8	36
>180	704,2	391,5	95,8	330,0	19,7	98,2	276
<b>Total</b>	<b>2939,7</b>	<b>3387,1</b>	<b>1544,3</b>	<b>1087,9</b>	<b>555,8</b>	<b>564,9</b>	<b>1287</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	10.69%		7.36%	10.08%	8.20%
15-35	10.69%		10.63%	10.00%	10.52%
36-60	-		10.39%	9.94%	9.95%
61-90	10.38%		10.35%	10.21%	10.35%
91-180	9.74%		10.17%	9.80%	9.92%
>180	8.58%		8.76%	8.72%	8.65%
<b>Total</b>	<b>10.20%</b>		<b>8.81%</b>	<b>9.70%</b>	<b>9.55%</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	21 – 25 ago.				28 ago. - 01 sep.				04 - 08 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	107	139	5272	5517	72	273	7373	8180	17	131	6201	5369
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2776	2391	0	0	4716	3420	0	0	3586	3192
Otros <sup>c</sup>	139	107	405	543	273	72	1540	2027	131	17	276	1495
<b>Total</b>	<b>246</b>	<b>246</b>	<b>8453</b>	<b>8451</b>	<b>345</b>	<b>345</b>	<b>13629</b>	<b>13627</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>10063</b>	<b>10056</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.