

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de septiembre de 2023**

**Fecha de Información: 31 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\$4432 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.52%<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	790,2	1008,5	231,1	219,6	218,9	12,1	558,5
15-35	1029,9	1174,1	696,9	377,3	35,2	210,6	442,0
36-60	750,5	514,9	0,0	0,0	14,9	250,5	500,0
61-90	134,2	298,5	205,0	55,0	18,5	4,2	75,0
91-180	61,6	10,8	0,0	0,0	10,8	0,0	61,6
>180	198,1	153,1	76,5	136,0	21,4	6,9	55,2
<b>Total</b>	<b>2964,5</b>	<b>3159,9</b>	<b>1209,5</b>	<b>787,9</b>	<b>319,7</b>	<b>484,3</b>	<b>1692,4</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	12.25%	2.66%	10.96%	9.21%
15-35	12.05%	12.04%	10.64%	11.58%
36-60	11.29%	10.98%	10.13%	10.90%
61-90	10.90%	9.67%	10.59%	10.01%
91-180	–	9.71%	10.06%	10.01%
>180	7.61%	8.82%	7.89%	7.95%
<b>Total</b>	<b>11.68%</b>	<b>8.67%</b>	<b>10.33%</b>	<b>10.52%</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	28 ago. - 01 sep.				04 - 08 sep.				11 - 15 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	41	79	4141	4564	26	145	7061	7735	42	148	7671	9247
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2796	2355	0	0	3999	3585	0	0	5695	2295
Otros <sup>c</sup>	79	41	553	568	145	26	1779	1513	148	42	422	1669
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>7490</b>	<b>7487</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>12839</b>	<b>12833</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>13788</b>	<b>13211</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.