

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2023**  
**Fecha de Información: 25 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\$2736 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.72%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	667,2	835,8	503,2	478,0	164,6	21,2	168
15-35	334,8	685,3	522,4	114,0	44,9	102,8	118
36-60	119,4	7,1	0,0	110,0	7,1	9,4	0
61-90	232,8	50,7	44,5	53,9	6,2	178,9	0
91-180	34,7	25,2	0,0	32,0	25,2	2,7	0
>180	17,5	11,1	10,0	5,1	1,1	12,4	0
<b>Total</b>	<b>1406,4</b>	<b>1615,1</b>	<b>1080,1</b>	<b>793,0</b>	<b>249,0</b>	<b>327,4</b>	<b>286</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		11.11%		11.04%	10.97%
15-35		11.16%		11.08%	11.09%
36-60		—		10.30%	10.28%
61-90		—		9.79%	9.69%
91-180		—		9.51%	9.56%
>180		—		7.78%	8.18%
<b>Total</b>		<b>11.13%</b>		<b>10.89%</b>	<b>10.34%</b>
					<b>10.72%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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>	65	256	10384	12379	88	98	6570	7236	87	134	5868	5970
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	6057	4510	0	0	4678	2908	0	0	3912	2344
Otros <sup>c</sup>	255	65	2474	2004	98	88	728	1819	134	87	425	1355
<b>Total</b>	<b>321</b>	<b>321</b>	<b>18915</b>	<b>18893</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>11976</b>	<b>11963</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>10205</b>	<b>9669</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.