

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 04 de septiembre de 2023¹

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\$83 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.07%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,6	24,8	0,0	0	3,5	4,3	21,4
15-35	9,4	3,2	0,7	5	2,5	4,4	0,0
36-60	1,4	17,2	0,0	0	17,2	1,4	0,0
61-90	1,1	15,3	0,0	0	15,3	1,1	0,0
91-180	0,3	2,8	0,0	0	2,8	0,3	0,0
>180	2,0	3,6	0,0	0	1,6	0,0	2,0
Total	39,8	67,0	0,7	5	42,9	11,4	23,4

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c 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 ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11.56%	12.30%	3.76%	10.50%
15-35	–	12.62%	11.88%	12.11%
36-60	–	12.55%	10.86%	12.43%
61-90	–	10.77%	10.88%	10.77%
91-180	–	9.94%	10.21%	9.96%
>180	8.25%	9.35%	–	8.74%
Total	11.28%	11.60%	8.85%	11.07%

^a 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.

¹A 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.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	04 – 08 sep.				11 - 15 sep.				18 - 22 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	150	7381	8023	46	149	8159	9929	19	209	5695	6520
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4108	3735	0	0	5752	2437	0	0	4107	2798
Otros ^c	150	33	1789	1514	149	46	703	1671	209	19	507	974
Total	183	183	13278	13272	195	195	14614	14037	228	228	10309	10292

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.