

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 05 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\$3809 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.90%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	754,5	1226,2	293,3	338,7	570,4	0,0	415,8
15-35	676,3	787,5	355,5	204,7	0,0	116,9	354,7
36-60	607,4	106,3	90,6	40,0	5,7	557,4	10,0
61-90	4,5	10,3	0,1	0,0	8,0	2,3	2,3
91-180	121,3	187,1	172,2	105,0	3,9	5,3	11,0
>180	95,2	38,9	21,8	80,0	4,2	2,2	13,0
Total	2259,2	2356,4	933,5	768,5	592,1	684,0	806,7

^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	12.26%	8.17%	11.92%	10.11%
15-35	12.24%	12.17%	12.06%	12.17%
36-60	10.99%	12.18%	10.87%	10.96%
61-90	10.90%	10.38%	10.05%	10.41%
91-180	10.02%	10.11%	9.62%	10.07%
>180	8.62%	8.94%	8.56%	8.61%
Total	12.13%	9.78%	11.33%	10.90%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	34	148	7664	8248	47	151	8488	10730	19	209	5848	6727
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4258	3781	0	0	5843	2613	0	0	4259	2899
Otros ^c	148	34	1801	1687	151	47	1265	1675	209	19	512	977
Total	182	182	13723	13716	198	198	15596	15018	228	228	10619	10603

^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.