

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 06 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\$3020 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.59%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	297,1	744,2	498,8	170,1	126,9	8,5	118,5
15-35	421,6	666,7	507,7	316,1	107,5	54,0	51,5
36-60	40,4	3,9	0,0	30,0	3,9	10,4	0,0
61-90	107,4	23,7	0,7	0,0	23,1	107,4	0,0
91-180	536,3	160,7	90,0	336,7	14,2	143,1	56,5
>180	63,6	181,0	155,4	60,0	25,7	3,6	0,0
Total	1466,3	1780,3	1252,5	912,9	301,3	327,0	226,5

^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	11.84%	10.30%	11.85%	10.74%
15-35	12.20%	11.57%	12.00%	11.75%
36-60	–	11.28%	10.85%	10.97%
61-90	–	10.42%	9.97%	10.05%
91-180	9.77%	9.93%	9.83%	9.82%
>180	–	7.76%	8.27%	7.78%
Total	11.41%	10.51%	10.44%	10.59%

^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	28	81	5105	5760	52	153	8662	10854	19	209	5938	7124
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3115	2487	0	0	5867	2745	0	0	4534	2925
Otros ^c	81	28	915	888	153	52	1327	1677	209	19	573	979
Total	109	109	9135	9135	205	205	15856	15276	228	228	11045	11028

^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.