

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 07 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\$3228 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.21%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	387,9	439,0	105,8	261,6	215,3	8,3	118
15-35	623,2	1003,9	446,1	317,5	326,8	74,7	231
36-60	83,1	87,9	38,0	38,0	29,9	25,1	20
61-90	399,7	274,0	130,4	80,0	18,6	194,7	125
91-180	6,2	35,1	1,3	0,0	33,8	6,2	0
>180	277,3	114,4	100,0	165,5	4,4	101,8	10
Total	1777,5	1954,2	821,6	862,6	628,7	410,9	504

^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	12.29%	9.76%	10.96%	10.68%
15-35	12.11%	12.32%	12.16%	12.25%
36-60	9.83%	10.76%	11.13%	10.68%
61-90	10.66%	10.86%	10.52%	10.60%
91-180	–	9.57%	9.50%	9.56%
>180	9.23%	9.24%	8.58%	8.69%
Total	11.65%	11.48%	10.48%	11.21%

^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	23	54	2850	3566	55	162	9004	11189	19	210	6041	7246
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2166	1461	0	0	5940	3005	0	0	4586	2971
Otros ^c	54	23	285	274	162	55	1510	1679	210	19	594	986
Total	77	77	5301	5301	217	217	16454	15873	229	229	11221	11203

^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.