

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 08 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\$4132 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.73%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1370,1	865,5	556,3	1197,2	158,7	22,4	150,5
15-35	562,0	1104,1	777,1	304,0	83,4	14,5	243,5
36-60	24,2	98,4	50,0	0,0	28,4	4,2	20,0
61-90	44,4	119,7	61,2	0,0	18,5	4,4	40,0
91-180	12,4	16,9	0,0	10,0	16,9	2,4	0,0
>180	302,4	75,9	55,8	149,0	10,2	143,3	10,0
Total	2315,5	2280,5	1500,4	1660,2	316,1	191,3	464,0

^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	12.58%		8.08%	10.13%	9.66%
15-35	12.47%		12.25%	12.33%	12.32%
36-60	12.42%		12.29%	11.76%	12.30%
61-90	11.51%		10.81%	10.79%	11.19%
91-180	-		10.05%	10.09%	10.06%
>180	8.17%		9.25%	8.91%	8.89%
Total	12.33%		10.52%	10.23%	10.73%

^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	16	30	429	407	72	167	9989	11703	20	217	6341	7562
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	250	260	0	0	6209	3884	0	0	4859	3231
Otros ^c	30	16	63	75	167	72	1653	1683	217	20	598	987
Total	46	46	742	742	239	239	17851	17270	237	237	11798	11780

^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.