

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 11 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\$3535 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.97%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	780,0	977,9	769,5	670,7	112,9	13,8	95,5
15-35	641,7	503,2	246,5	422,8	61,7	24,0	195,0
36-60	130,1	173,8	120,0	45,1	17,8	49,0	36,0
61-90	0,7	15,4	0,3	0,0	15,2	0,7	0,0
91-180	268,6	182,1	70,0	130,0	75,1	101,6	37,0
>180	93,8	162,4	128,0	60,0	3,1	2,5	31,3
Total	1914,8	2014,8	1334,3	1328,5	285,8	191,5	394,8

^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	12.32%	9.97%	10.68%	10.44%
15-35	12.27%	11.92%	12.48%	12.26%
36-60	11.28%	11.68%	11.31%	11.40%
61-90	–	11.28%	9.89%	11.22%
91-180	10.09%	9.88%	9.48%	9.72%
>180	9.03%	7.70%	8.58%	8.28%
Total	11.73%	10.41%	11.27%	10.97%

^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	11 – 15 sep.				18 - 22 sep.				25 - 29 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	74	169	10549	11912	21	218	6429	8009	50	230	7607	8308
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6336	4372	0	0	5179	3292	0	0	4378	3037
Otros ^c	169	74	1679	1700	218	21	706	995	230	50	1240	1860
Total	243	243	18564	17984	239	239	12314	12296	280	280	13225	13205

^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.