

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 12 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\$4322 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.88%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	985,6	1030,8	569,7	727,8	374,2	170,8	87,0
15-35	701,7	934,2	424,1	287,4	141,8	46,0	368,3
36-60	504,6	207,9	60,0	0,0	18,9	375,6	129,0
61-90	41,2	14,5	0,4	0,0	14,0	41,2	0,0
91-180	266,7	241,3	10,0	86,3	52,3	1,4	179,0
>180	114,1	77,6	28,0	78,0	14,6	1,1	35,0
Total	2613,9	2506,3	1092,2	1179,5	615,9	636,2	798,3

^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	11.65%		2.61%	6.10%	4.76%
15-35	11.68%		11.66%	11.77%	11.69%
36-60	10.72%		11.17%	9.39%	9.81%
61-90	-		10.80%	10.91%	10.88%
91-180	9.74%		9.76%	9.76%	9.74%
>180	8.92%		8.57%	5.32%	7.80%
Total	10.96%		7.15%	8.91%	8.88%

^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	52	131	9893	10469	22	223	6613	8566	50	232	7739	8868
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5458	4283	0	0	5321	3397	0	0	4839	3084
Otros ^c	131	52	1523	1576	223	22	1070	998	232	50	1278	1882
Total	183	183	16874	16328	245	245	13004	12961	282	282	13856	13834

^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.