

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2023
Fecha de Información: 13 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\$4603 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.24%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1380,2	752,4	447,7	1100,1	35,6	11,2	269,0
15-35	616,3	1271,6	1163,1	389,4	44,5	163,0	64,0
36-60	62,5	85,5	39,3	34,7	21,2	2,7	25,0
61-90	43,8	70,8	40,2	0,0	29,6	42,8	1,0
91-180	315,1	135,1	8,3	267,3	83,1	4,1	43,6
>180	62,5	209,8	181,0	61,4	28,8	1,1	0,0
Total	2480,3	2525,1	1879,6	1852,9	242,8	224,8	402,6

^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	10.96%		10.19%	9.96%	10.28%
15-35	11.25%		10.68%	9.84%	10.44%
36-60	10.77%		10.91%	10.92%	10.85%
61-90	10.30%		10.07%	10.09%	10.08%
91-180	9.57%		9.62%	9.52%	9.55%
>180	—		8.91%	8.04%	8.88%
Total	10.84%		10.43%	9.83%	10.24%

^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.

¹ A 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.

² El 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	41	113	7749	7618	22	229	6992	8888	50	234	7953	9100
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4048	3614	0	0	5528	3661	0	0	4945	3169
Otros ^c	113	41	786	803	229	22	1075	1002	234	50	1280	1888
Total	154	154	12583	12035	251	251	13595	13551	284	284	14178	14157

^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.