

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 18 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\$3173 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.74%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	589,4	1095,0	302,1	259,6	476,9	13,8	316,0
15-35	601,3	694,2	255,5	189,0	30,3	4,0	408,4
36-60	472,6	173,4	140,0	50,0	33,4	422,6	0,0
61-90	4,2	23,2	0,0	0,0	23,2	4,2	0,0
91-180	142,7	37,2	0,0	141,7	37,2	1,0	0,0
>180	51,2	31,7	0,0	30,0	12,6	2,1	19,1
Total	1861,4	2054,7	697,6	670,3	613,6	447,7	743,4

^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	11.58%	10.57%	9.77%	10.70%
15-35	11.48%	10.53%	11.43%	11.20%
36-60	–	10.91%	10.36%	10.40%
61-90	–	10.27%	9.63%	10.17%
91-180	–	9.47%	9.42%	9.47%
>180	8.48%	8.76%	7.47%	8.52%
Total	11.45%	10.50%	10.38%	10.74%

^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	18 – 22 sep.				25 - 29 sep.				02 - 06 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	27	252	7754	9586	55	242	8406	10157	45	95	5973	5975
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5901	4072	0	0	5273	3340	0	0	4018	2837
Otros ^c	252	27	1106	1059	242	55	1746	1908	95	45	584	1750
Total	279	279	14761	14717	297	297	15425	15405	140	140	10575	10562

^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.