

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 19 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\$4500 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.29%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	963,1	812,5	149,3	527,4	349,2	121,7	314,0
15-35	1094,2	1469,7	598,9	345,0	129,7	8,1	741,1
36-60	547,2	257,8	40,0	0,0	8,8	338,2	209,0
61-90	27,5	30,7	0,0	0,0	30,7	27,5	0,0
91-180	273,0	25,7	0,0	260,0	15,7	3,0	10,0
>180	153,0	219,4	90,0	40,0	29,4	13,0	100,0
Total	3058,0	2815,8	878,2	1172,4	563,5	511,5	1374,1

^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	11.31%	10.14%	8.44%	10.01%
15-35	11.03%	11.04%	11.06%	11.04%
36-60	10.26%	10.43%	9.87%	10.04%
61-90	–	9.85%	9.68%	9.77%
91-180	9.53%	9.45%	9.58%	9.57%
>180	8.50%	8.13%	8.05%	8.25%
Total	10.78%	10.39%	9.66%	10.29%

^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	20	219	4747	5586	58	243	8851	10872	45	96	6044	6090
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3404	2506	0	0	5397	3527	0	0	4071	2880
Otros ^c	219	20	447	497	243	58	2089	1917	96	45	626	1758
Total	239	239	8598	8589	301	301	16337	16316	141	141	10741	10728

^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.