

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 20 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\$3211 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.35%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	943,1	468,2	235,9	669,3	8,3	49,7	224
15-35	530,6	1152,6	830,1	214,5	17,5	11,1	305
36-60	51,6	64,9	0,0	0,0	14,9	1,6	50
61-90	78,6	106,4	39,3	30,0	22,0	3,6	45
91-180	299,4	144,9	6,9	220,0	63,0	4,4	75
>180	55,2	34,3	7,3	12,6	7,0	22,5	20
Total	1958,5	1971,2	1119,5	1146,5	132,8	93,0	719

^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	10.84%	10.95%	9.80%	10.25%
15-35	10.76%	10.77%	10.68%	10.75%
36-60	10.51%	10.80%	11.12%	10.59%
61-90	9.95%	10.00%	9.45%	9.96%
91-180	9.41%	10.18%	9.44%	9.60%
>180	8.75%	8.42%	7.50%	8.14%
Total	10.50%	10.69%	9.87%	10.35%

^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	18	200	4361	4973	59	242	9233	11086	46	96	6138	6230
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2927	2183	0	0	5457	3747	0	0	4149	2880
Otros ^c	200	18	390	513	242	59	2093	1930	96	46	628	1792
Total	218	218	7678	7669	301	301	16783	16763	142	142	10915	10902

^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.