

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 21 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\$2845 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.02%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	859,8	872,7	373,0	565,9	220,4	14,6	279,3
15-35	361,2	596,4	357,8	131,8	14,7	5,4	224,0
36-60	172,9	5,0	0,0	0,0	5,0	172,9	0,0
61-90	41,8	45,4	26,7	0,5	18,7	41,3	0,0
91-180	6,5	157,8	134,2	0,0	23,6	6,5	0,0
>180	86,3	157,3	140,5	66,3	1,8	4,9	15,0
Total	1528,5	1834,6	1032,2	764,6	284,1	245,6	518,3

^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	10.43%	9.43%	10.34%	9.94%
15-35	10.54%	10.56%	10.31%	10.54%
36-60	–	10.42%	9.37%	9.40%
61-90	–	9.91%	9.51%	9.63%
91-180	–	9.50%	8.71%	9.33%
>180	7.74%	8.42%	7.83%	7.83%
Total	10.40%	9.86%	9.77%	10.02%

^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	11	153	3685	3880	61	244	9473	11510	46	97	6359	6676
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2317	1998	1	0	5614	3889	0	0	4357	2880
Otros ^c	152	11	284	403	243	61	2271	1939	97	46	668	1814
Total	163	164	6286	6281	305	305	17358	17338	143	143	11384	11370

^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.