

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 22 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\$2189 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.36%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	344,5	502,5	260,1	144,0	108,3	66,5	134,0
15-35	755,3	836,8	465,2	354,2	13,1	42,6	358,5
36-60	90,4	10,2	0,0	80,0	10,2	10,4	0,0
61-90	48,0	32,8	21,1	26,6	11,7	21,4	0,0
91-180	7,0	12,0	0,4	0,0	11,5	7,0	0,0
>180	15,0	27,4	19,7	15,0	7,7	0,0	0,0
Total	1260,2	1421,7	766,5	619,7	162,7	148,0	492,5

^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	10.54%		10.81%	10.53%	10.63%
15-35	10.53%		8.53%	7.62%	8.87%
36-60	-		10.50%	9.81%	10.15%
61-90	-		9.76%	9.65%	9.70%
91-180	-		9.48%	8.84%	9.24%
>180	-		7.72%	-	7.72%
Total	10.54%		9.15%	8.55%	9.36%

^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	7	95	781	916	63	254	9636	11824	86	98	6455	6818
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	704	573	1	0	5862	4001	0	0	4369	2903
Otros ^c	94	7	88	84	254	63	2308	1960	98	86	728	1817
Total	101	102	1573	1573	318	317	17806	17785	184	184	11552	11538

^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.