

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 25 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\$2736 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.72%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	667,2	835,8	503,2	478,0	164,6	21,2	168
15-35	334,8	685,3	522,4	114,0	44,9	102,8	118
36-60	119,4	7,1	0,0	110,0	7,1	9,4	0
61-90	232,8	50,7	44,5	53,9	6,2	178,9	0
91-180	34,7	25,2	0,0	32,0	25,2	2,7	0
>180	17,5	11,1	10,0	5,1	1,1	12,4	0
Total	1406,4	1615,1	1080,1	793,0	249,0	327,4	286

^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	11.11%	11.04%	10.75%	10.97%
15-35	11.16%	11.08%	11.04%	11.09%
36-60	–	10.30%	10.28%	10.28%
61-90	–	9.79%	9.69%	9.71%
91-180	–	9.51%	9.56%	9.54%
>180	–	7.78%	8.18%	7.99%
Total	11.13%	10.89%	10.34%	10.72%

^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	25 – 29 sep.				02 - 06 oct.				09 - 13 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	65	256	10384	12379	88	98	6570	7236	87	134	5868	5970
Intragrupa y off-shore ^b	1	0	6057	4510	0	0	4678	2908	0	0	3912	2344
Otros ^c	255	65	2474	2004	98	88	728	1819	134	87	425	1355
Total	321	321	18915	18893	186	186	11976	11963	221	221	10205	9669

^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.