

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2023
Fecha de Información: 14 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\$3591 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.47%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	328,9	392,9	286,6	248,1	36,3	10,8	70
15-35	513,5	945,3	610,8	214,6	43,5	8,0	291
36-60	42,2	127,0	86,0	0,0	21,0	22,2	20
61-90	165,9	385,0	234,2	31,5	36,8	20,4	114
91-180	719,0	223,6	27,5	579,7	57,1	0,2	139
>180	188,1	223,2	168,7	158,1	25,4	1,0	29
Total	1957,5	2296,9	1413,8	1231,9	220,1	62,5	663

^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	11.47%		11.47%	10.28%	10.97%
15-35	11.45%		10.36%	11.36%	10.92%
36-60	10.73%		10.82%	11.67%	10.98%
61-90	10.29%		10.30%	9.89%	10.26%
91-180	9.80%		9.39%	9.68%	9.68%
>180	8.40%		8.53%	7.88%	8.19%
Total	10.73%		10.38%	10.25%	10.47%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	11 - 15 sep.				18 - 22 sep.				25 - 29 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	72	4525	4702	23	232	7010	9105	51	238	8070	9185
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2523	2452	0	0	5721	3674	0	0	5015	3272
Otros ^c	72	31	556	440	232	23	1098	1007	238	51	1285	1893
Total	103	103	7604	7594	255	255	13829	13786	289	289	14370	14350

^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.