

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 27 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\$4520 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.96%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	981,2	818,7	190,2	698,3	464,4	118,9	164,0
15-35	729,1	1244,0	837,2	353,0	245,8	215,1	161,0
36-60	112,5	56,4	50,0	0,0	6,4	112,5	0,0
61-90	265,1	318,4	222,0	71,2	11,4	0,0	193,9
91-180	255,6	30,6	0,2	115,5	25,4	135,1	5,0
>180	93,2	181,2	134,8	18,5	4,5	32,7	42,0
Total	2436,6	2649,3	1434,4	1256,6	757,9	614,2	565,9

^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	11.44%		9.29%	9.86%	9.80%
15-35	10.96%		10.54%	10.49%	10.58%
36-60	-		11.02%	10.49%	10.52%
61-90	9.78%		9.89%	9.11%	9.60%
91-180	8.88%		9.46%	9.16%	9.19%
>180	8.05%		7.89%	8.09%	7.97%
Total	10.63%		9.86%	9.88%	9.96%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	26	177	7281	7950	92	99	7173	8637	93	132	6186	6601
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	3857	3404	0	0	4902	3089	0	0	4268	2356
Otros ^c	176	26	1573	1335	99	92	1493	1827	132	93	429	1390
Total	203	203	12711	12689	191	191	13568	13553	225	225	10883	10347

^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.