

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de octubre de 2023

Fecha de Información: 29 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\$3464 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.45%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	757,9	1154,9	246,5	333,4	513,4	29,5	395,0
15-35	882,2	934,4	243,3	179,5	157,6	169,2	533,5
36-60	1,0	17,5	0,0	0,0	17,5	1,0	0,0
61-90	109,8	158,3	40,0	0,0	13,3	4,8	105,0
91-180	344,7	26,2	0,3	0,0	25,9	344,7	0,0
>180	35,5	94,1	71,8	16,0	3,3	0,5	19,0
Total	2131,0	2385,4	601,9	528,9	731,0	549,6	1052,5

^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	10.64%		7.06%	9.72%	8.60%
15-35	10.59%		10.91%	10.60%	10.68%
36-60	-		10.22%	9.56%	10.18%
61-90	9.65%		10.00%	9.20%	9.67%
91-180	-		9.46%	8.58%	8.64%
>180	7.76%		7.59%	7.93%	7.74%
Total	10.46%		8.34%	9.52%	9.45%

^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	16	49	861	830	96	109	8075	9575	112	132	6485	7384
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	250	478	0	0	5298	3639	0	0	4400	2404
Otros ^c	48	16	411	202	109	96	1701	1846	132	112	837	1398
Total	65	65	1522	1510	205	205	15074	15060	244	244	11722	11186

^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.