

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2023
Fecha de Información: 20 de octubre 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\$2625 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.60%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	724,4	630,7	350,7	523,6	103,7	24,5	176,3
15-35	630,7	814,4	430,8	174,5	22,6	95,2	361,0
36-60	36,6	4,2	0,0	0,0	4,2	36,6	0,0
61-90	15,7	69,2	45,0	0,0	9,2	0,7	15,0
91-180	87,9	44,6	0,0	60,0	29,6	12,9	15,0
>180	96,6	77,2	28,0	56,6	9,2	0,0	40,0
Total	1591,9	1640,3	854,5	814,8	178,5	169,9	607,3

^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	11.83%	11.90%	11.72%	11.80%
15-35	12.26%	12.22%	10.99%	11.94%
36-60	–	11.82%	11.52%	11.55%
61-90	11.02%	9.57%	10.60%	9.94%
91-180	10.34%	10.53%	10.14%	10.29%
>180	8.98%	9.26%	9.52%	9.28%
Total	11.84%	11.82%	11.16%	11.60%

^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	16 – 20 oct.				23 - 27 oct.				30 oct. - 03 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	16	41	1069	975	157	248	7748	9303	68	300	6322	7938
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	596	710	0	0	5329	3577	0	0	4586	2100
Otros ^c	41	16	69	49	248	157	1291	1481	300	68	928	1798
Total	57	57	1734	1734	405	405	14368	14361	368	368	11836	11836

^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.