

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2023
Fecha de Información: 24 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\$4249 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.43%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	912,2	1175,3	312,3	475,0	436,5	10,7	426,5
15-35	715,1	872,0	374,0	432,4	283,0	67,7	215,0
36-60	171,7	181,3	140,0	89,0	11,3	52,7	30,0
61-90	193,0	10,5	0,0	0,0	10,5	193,0	0,0
91-180	487,0	153,9	130,0	0,0	3,9	467,0	20,0
>180	7,8	60,8	41,0	2,6	19,8	5,2	0,0
Total	2486,8	2453,7	997,3	999,0	764,9	796,3	691,5

^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	11.84%	8.36%	11.46%	10.25%
15-35	11.78%	11.64%	10.01%	11.07%
36-60	10.48%	9.75%	10.85%	10.13%
61-90	–	10.92%	9.73%	9.79%
91-180	10.43%	9.17%	10.09%	9.90%
>180	–	9.26%	7.91%	8.97%
Total	11.72%	9.89%	10.39%	10.43%

^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	23 – 27 oct.				30 oct. - 03 nov.				06 - 10 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	155	185	7417	8487	83	316	6941	8852	32	92	7207	7552
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4642	3259	0	0	4722	2505	0	0	4440	2878
Otros ^c	185	155	1234	1540	316	83	1501	1808	92	32	697	1365
Total	340	340	13293	13286	399	399	13164	13165	124	124	12344	11795

^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.