

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2023
Fecha de Información: 25 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\$3693 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.50%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	880,7	510,4	446,5	830,8	26,1	12,0	37,8
15-35	804,2	1348,8	844,4	430,2	190,4	60,0	314,0
36-60	23,2	90,1	71,1	0,0	9,0	13,2	10,0
61-90	98,6	61,7	42,6	0,0	19,1	98,6	0,0
91-180	127,0	24,3	0,0	20,0	14,3	97,0	10,0
>180	94,6	27,3	0,0	61,0	1,3	7,6	26,0
Total	2028,3	2062,6	1404,7	1342,1	260,1	288,4	397,8

^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	11.26%	10.87%	9.69%	9.95%
15-35	11.09%	11.00%	11.03%	11.03%
36-60	10.00%	10.37%	10.33%	10.31%
61-90	–	10.41%	9.76%	10.01%
91-180	9.90%	9.93%	9.94%	9.94%
>180	8.98%	9.63%	9.14%	9.10%
Total	10.91%	10.90%	9.98%	10.50%

^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	149	156	6024	7072	85	319	7342	8936	33	94	7227	7716
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4186	2821	0	0	4743	2854	0	0	4501	2888
Otros ^c	156	149	771	1083	319	85	1521	1816	94	33	789	1365
Total	305	305	10981	10976	404	404	13606	13606	127	127	12517	11969

^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.