

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2023
Fecha de Información: 26 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\$4475 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.69%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	1165,0	793,1	448,1	860,9	151,3	110,4	193,7
15-35	885,6	1141,4	580,8	642,5	348,7	31,3	211,9
36-60	112,6	49,7	30,0	0,0	19,7	112,6	0,0
61-90	36,2	135,2	100,6	5,0	24,7	21,2	10,0
91-180	211,8	265,3	240,8	76,5	24,5	135,3	0,0
>180	62,4	47,1	15,0	40,0	17,1	7,4	15,0
Total	2473,7	2431,8	1415,3	1624,9	585,9	418,2	430,6

^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	10.11%		8.33%	9.74%	9.37%
15-35	10.21%		10.10%	10.17%	10.13%
36-60	-		10.30%	9.86%	10.00%
61-90	9.76%		9.65%	9.88%	9.71%
91-180	-		9.51%	9.43%	9.48%
>180	8.38%		8.71%	8.41%	8.51%
Total	10.09%		9.49%	9.78%	9.69%

^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	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	140	94	4922	5510	86	324	7951	9524	34	95	7453	7764
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2951	2367	0	0	4956	3141	0	0	4517	3061
Otros ^c	94	140	635	627	324	86	1664	1905	95	34	795	1392
Total	234	234	8508	8504	410	410	14571	14570	129	129	12765	12217

^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.