

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2023
Fecha de Información: 27 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\$2340 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.25%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	540,6	507,0	302,0	284,8	34,8	85,5	170,2
15-35	390,0	621,0	293,0	272,5	256,5	46,0	71,5
36-60	27,8	78,9	26,2	0,0	34,5	9,6	18,2
61-90	1,4	19,4	0,2	0,0	19,2	1,4	0,0
91-180	119,7	55,6	35,4	5,7	19,7	113,6	0,5
>180	186,6	64,5	48,6	160,0	3,8	14,5	12,1
Total	1266,1	1346,4	705,5	723,0	368,4	270,6	272,5

^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	9.81%		9.61%	8.83%	9.25%
15-35	9.79%		9.77%	7.91%	9.35%
36-60	9.79%		9.82%	9.53%	9.76%
61-90	-		9.68%	9.36%	9.66%
91-180	9.01%		9.28%	9.31%	9.30%
>180	8.66%		8.59%	8.26%	8.40%
Total	9.75%		9.66%	8.64%	9.25%

^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	27	69	1847	2256	91	327	8347	9903	34	96	7548	7766
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1441	1068	0	0	5246	3401	0	0	4517	3152
Otros ^c	69	27	182	142	327	91	1692	1980	96	34	797	1396
Total	96	96	3470	3466	418	418	15285	15284	130	130	12862	12314

^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.