

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de noviembre de 2023
Fecha de Información: 31 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\$2902 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.84%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	503,9	655,6	328,5	389,5	253,6	40,9	73,5
15-35	631,8	919,9	532,2	219,6	24,1	48,7	363,5
36-60	134,9	97,5	70,0	107,5	7,5	7,4	20,0
61-90	10,7	6,2	0,0	0,0	6,2	10,7	0,0
91-180	234,5	25,5	0,0	8,0	15,5	216,5	10,0
>180	113,3	55,2	26,5	76,1	8,7	17,2	20,0
Total	1629,1	1759,9	957,3	800,7	315,7	341,4	487,0

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	8.87%		9.03%	7.87%	8.52%
15-35	8.81%		8.74%	10.69%	9.21%
36-60	9.02%		8.49%	8.98%	8.73%
61-90	—		9.57%	8.87%	9.13%
91-180	8.91%		9.09%	8.64%	8.68%
>180	8.27%		7.75%	8.36%	8.23%
Total	8.81%		8.83%	8.85%	8.84%

^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.

¹ A 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.

² El 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	30 oct. - 03 nov.				06 - 10 nov.				13 - 17 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	69	157	7720	8905	39	104	7994	8641	113	174	5240	6198
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5033	3542	0	0	4726	3408	0	0	3398	1871
Otros ^c	157	69	1075	1380	104	39	1298	1421	174	113	1127	1693
Total	226	226	13828	13827	143	143	14018	13470	287	287	9765	9762

^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.