

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de noviembre de 2023

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$3662 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.91%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	1387,9	1152,8	349,1	582,5	28,2	29,9	775,5
15-35	690,0	978,9	547,3	271,0	27,9	15,3	403,7
36-60	52,4	65,2	25,0	0,0	5,2	17,4	35,0
61-90	146,0	106,2	0,0	0,0	6,2	46,0	100,0
91-180	46,0	30,2	0,0	0,0	10,2	26,0	20,0
>180	271,2	292,2	67,0	40,6	2,2	7,6	223,0
Total	2593,5	2625,4	988,3	894,1	79,9	142,2	1557,2

^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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	9.66%		8.89%	7.47%	8.80%
15-35	9.08%		9.92%	8.48%	9.29%
36-60	8.93%		9.05%	8.46%	8.84%
61-90	9.29%		9.06%	8.62%	9.07%
91-180	8.86%		9.20%	8.78%	8.88%
>180	8.18%		7.36%	7.70%	8.04%
Total	9.25%		9.44%	7.87%	8.91%

^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 intragruppo.

“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	41	134	6756	7620	39	104	8575	9284	113	175	5287	6241
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4206	2942	0	0	4884	3507	0	0	3398	1871
Otros ^c	134	41	818	1219	104	39	1304	1425	175	113	1147	1718
Total	175	175	11780	11781	143	143	14763	14216	288	288	9832	9830

^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.