

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de noviembre de 2023

Fecha de Información: 02 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\$4396 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.58%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	1541,1	1482,1	160,0	226,4	21,5	14,2	1300,6
15-35	920,7	1055,8	455,6	309,3	30,3	41,4	570,0
36-60	50,9	90,9	40,0	50,0	50,9	0,9	0,0
61-90	483,8	597,1	80,0	10,0	67,1	23,8	450,0
91-180	108,2	114,3	56,9	40,0	22,3	33,2	35,0
>180	167,6	149,0	135,5	48,2	3,5	109,3	10,0
Total	3272,3	3489,2	928,0	683,9	195,6	222,8	2365,6

^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	8.62%		9.02%	8.94%	8.67%
15-35	9.01%		8.97%	7.32%	8.57%
36-60	-		9.14%	8.70%	8.98%
61-90	8.59%		8.28%	8.74%	8.52%
91-180	8.84%		8.85%	8.68%	8.80%
>180	8.52%		7.43%	7.99%	7.79%
Total	8.71%		8.70%	7.94%	8.58%

^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	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	33	125	5602	6081	39	112	9542	10366	116	178	5672	6609
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3230	2483	0	0	5044	3555	0	0	3418	1905
Otros ^c	125	33	742	1010	112	39	1311	1428	178	116	1151	1725
Total	158	158	9574	9574	151	151	15897	15349	294	294	10241	10239

^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.