

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de octubre de 2023
Fecha de Información: 02 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\$4634 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.23%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	1269,1	1076,0	262,1	695,1	273,3	33,4	540,5
15-35	890,8	1233,2	762,7	279,2	48,0	189,1	422,5
36-60	621,3	466,8	25,2	6,3	1,6	175,0	440,0
61-90	11,4	16,3	6,7	3,0	9,6	8,4	0,0
91-180	22,9	70,6	60,2	10,7	10,3	12,2	0,0
>180	246,8	231,6	98,4	98,9	13,2	27,9	120,0
Total	3062,3	3094,5	1215,4	1093,2	356,0	446,1	1523,0

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11.07%	10.40%	10.77%	10.75%
15-35	10.38%	9.99%	9.21%	9.90%
36-60	10.37%	9.67%	10.11%	10.28%
61-90	–	9.59%	9.19%	9.37%
91-180	–	9.24%	9.13%	9.17%
>180	7.93%	8.53%	7.81%	7.96%
Total	10.43%	10.13%	10.12%	10.23%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	02 – 06 oct.				09 - 13 oct.				16 - 20 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	97	110	8813	9865	131	133	7112	8167	42	131	5820	6320
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5481	4180	0	0	4479	2558	0	0	2950	1489
Otros ^c	110	97	1736	1971	133	131	1076	1406	131	42	411	1371
Total	207	207	16030	16016	264	264	12667	12131	173	173	9181	9180

^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.