

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2023
Fecha de Información: 06 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\$2490 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.90%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	310,4	406,7	156,7	205,5	182,0	36,9	68,0
15-35	652,2	888,7	447,2	272,5	153,5	91,7	288,0
36-60	160,3	100,4	80,0	0,0	20,4	160,3	0,0
61-90	9,0	10,5	5,5	0,0	5,0	9,0	0,0
91-180	60,8	218,9	140,0	0,0	22,4	4,3	56,5
>180	48,9	43,5	33,0	3,5	2,5	37,4	8,0
Total	1241,7	1668,8	862,4	481,5	385,9	339,7	420,5

^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	12.18%	11.37%	8.51%	10.55%
15-35	11.99%	11.75%	10.85%	11.53%
36-60	–	10.99%	11.14%	11.12%
61-90	–	10.42%	9.98%	10.21%
91-180	9.92%	9.17%	9.00%	9.35%
>180	7.53%	8.50%	8.28%	8.30%
Total	11.66%	11.06%	10.23%	10.90%

^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	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	31	32	1569	1765	168	142	8140	9492	55	134	6045	6770
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1232	1092	0	0	4983	3335	0	0	3197	1540
Otros ^c	32	31	144	85	142	168	1689	1449	134	55	469	1399
Total	63	63	2945	2942	310	310	14812	14276	189	189	9711	9709

^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.