

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2023
Fecha de Información: 10 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\$3968 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.69%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	941,2	590,4	189,4	585,3	132,1	86,9	269,0
15-35	967,8	1452,1	923,8	500,7	160,8	99,6	367,5
36-60	137,9	162,7	104,7	0,0	28,0	107,9	30,0
61-90	10,5	15,5	0,0	5,0	15,5	5,5	0,0
91-180	34,1	180,1	130,5	0,0	19,6	4,1	30,0
>180	98,0	91,0	67,2	70,3	6,8	10,7	17,0
Total	2189,5	2491,9	1415,7	1161,4	362,7	314,6	713,5

^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	12.06%	12.04%	11.37%	11.69%
15-35	12.14%	12.05%	12.05%	12.07%
36-60	10.92%	11.14%	10.86%	10.98%
61-90	–	10.44%	10.15%	10.32%
91-180	10.14%	10.12%	9.41%	10.10%
>180	8.86%	8.76%	8.71%	8.76%
Total	11.89%	11.74%	11.50%	11.69%

^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	09 – 13 oct.				16 - 20 oct.				23 - 27 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	173	144	9201	9824	57	136	6099	7022	72	234	6360	6862
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5092	3991	0	0	3291	1547	0	0	4225	2764
Otros ^c	144	173	1704	1646	136	57	584	1404	234	72	454	1406
Total	317	317	15997	15461	193	193	9974	9973	306	306	11039	11032

^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.