

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2023
Fecha de Información: 12 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\$3581 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.17%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	990,9	985,6	262,8	598,7	396,3	65,7	326,5
15-35	796,1	1299,2	881,0	174,9	0,0	276,4	344,9
36-60	3,0	13,6	0,0	0,0	13,5	2,8	0,2
61-90	10,8	91,8	84,5	0,0	7,3	10,8	0,0
91-180	1,7	18,9	0,0	0,0	18,9	1,7	0,0
>180	9,3	32,5	30,0	5,0	1,4	3,2	1,1
Total	1811,8	2441,8	1258,3	778,5	437,5	360,6	672,6

^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	11.45%	10.74%	10.69%	10.90%
15-35	11.61%	11.76%	11.09%	11.54%
36-60	10.50%	11.27%	10.53%	11.14%
61-90	–	10.71%	10.40%	10.67%
91-180	–	9.66%	9.50%	9.65%
>180	9.10%	8.62%	7.76%	8.46%
Total	11.53%	11.17%	10.86%	11.17%

^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	62	79	4835	5577	63	140	6956	8350	75	235	6430	7362
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3204	2734	0	0	3623	1989	0	0	4454	2764
Otros ^c	79	62	884	586	140	63	1218	1456	235	75	666	1417
Total	141	141	8923	8897	203	203	11797	11795	310	310	11550	11543

^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.