

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2023
Fecha de Información: 13 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\$2329 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.40%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	684,8	360,4	131,0	474,9	43,5	24,0	185,9
15-35	416,1	908,3	652,6	72,8	43,2	130,9	212,5
36-60	33,4	15,4	0,0	0,0	14,4	32,4	1,0
61-90	33,9	11,8	0,0	0,0	11,8	33,9	0,0
91-180	7,3	42,2	10,0	4,7	32,2	2,6	0,0
>180	206,4	206,0	0,0	5,5	8,0	2,9	198,0
Total	1381,9	1544,1	793,6	557,8	153,1	226,8	597,4

^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	12.16%	12.20%	11.90%	12.03%
15-35	12.25%	11.75%	10.77%	11.67%
36-60	11.05%	11.79%	11.21%	11.38%
61-90	–	10.56%	10.97%	10.86%
91-180	–	10.07%	9.64%	10.01%
>180	8.25%	8.63%	7.35%	8.23%
Total	10.89%	11.71%	11.44%	11.40%

^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	30	46	1670	1836	71	143	7478	8598	80	237	6692	7617
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1040	1111	0	0	3768	2434	0	0	4535	2857
Otros ^c	46	30	363	125	143	71	1249	1461	237	80	677	1423
Total	76	76	3073	3072	214	214	12495	12493	317	317	11904	11897

^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.