

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2023
Fecha de Información: 17 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\$3043 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.19%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	671,2	657,2	345,0	484,0	242,2	117,2	70
15-35	721,5	781,1	533,1	495,9	92,0	69,6	156
36-60	82,8	14,9	0,0	65,0	14,9	17,8	0
61-90	1,9	15,1	0,1	0,0	15,1	1,9	0
91-180	8,0	74,2	50,0	2,0	24,2	6,0	0
>180	200,0	239,1	13,0	0,0	28,1	2,0	198
Total	1685,4	1781,7	941,2	1046,9	416,5	214,6	424

^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	12.44%	10.78%	10.53%	10.79%
15-35	12.41%	11.95%	12.28%	12.14%
36-60	–	12.07%	11.54%	11.62%
61-90	–	11.11%	11.00%	11.10%
91-180	–	10.50%	9.99%	10.45%
>180	8.67%	8.82%	8.41%	8.69%
Total	10.67%	11.22%	11.39%	11.19%

^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	16 – 20 oct.				23 - 27 oct.				30 oct. - 03 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	73	143	8095	8902	84	241	6890	7885	62	297	5579	6964
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3873	2793	0	0	4703	2962	0	0	4079	1730
Otros ^c	143	73	1436	1707	241	84	698	1436	297	62	811	1774
Total	216	216	13404	13402	325	325	12291	12283	359	359	10469	10468

^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.