

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2023
Fecha de Información: 18 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\$4783 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.44%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1063,8	1110,2	428,8	874,8	528,0	35,6	153,4
15-35	1480,5	1461,5	696,0	114,5	0,0	638,0	728,0
36-60	31,4	57,3	48,0	0,0	4,3	26,4	5,0
61-90	58,8	42,0	10,0	44,0	22,0	4,8	10,0
91-180	15,0	24,0	6,5	0,0	14,0	11,5	3,5
>180	235,7	301,1	98,2	30,1	4,9	7,7	198,0
Total	2885,2	2996,1	1287,5	1063,4	573,2	723,9	1097,9

^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	12.49%	10.21%	11.88%	11.16%
15-35	12.55%	12.29%	11.30%	12.05%
36-60	11.78%	11.71%	11.74%	11.73%
61-90	11.56%	10.80%	11.54%	11.34%
91-180	9.99%	10.65%	10.15%	10.37%
>180	8.40%	8.56%	7.88%	8.41%
Total	11.77%	11.09%	11.56%	11.44%

^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	33	92	6710	7359	88	241	7380	8632	64	298	5874	7531
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3284	2577	0	0	4899	3363	0	0	4350	1770
Otros ^c	92	33	1348	1404	241	88	1177	1454	298	64	861	1785
Total	125	125	11342	11340	329	329	13456	13449	362	362	11085	11086

^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.