

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2023
Fecha de Información: 19 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\$3502 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.46%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	709,9	879,7	740,8	577,3	83,8	77,6	55
15-35	921,0	885,0	475,8	499,8	72,3	84,2	337
36-60	175,6	87,7	70,0	46,9	17,7	128,7	0
61-90	11,6	14,6	10,0	8,0	4,6	3,6	0
91-180	18,7	100,3	90,8	10,0	9,6	8,7	0
>180	36,0	53,8	38,5	34,5	15,3	1,5	0
Total	1872,8	2021,1	1425,8	1176,5	203,3	304,3	392

^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	12.59%	11.56%	8.37%	10.17%
15-35	12.59%	12.57%	13.16%	12.74%
36-60	–	12.81%	12.07%	12.37%
61-90	–	11.58%	11.53%	11.56%
91-180	–	10.72%	10.09%	10.63%
>180	–	9.53%	8.57%	8.97%
Total	12.59%	11.98%	10.38%	11.46%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	26	65	4689	5222	151	243	7501	8943	66	299	5909	7749
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2717	2240	0	0	5062	3394	0	0	4533	1770
Otros ^c	65	26	676	619	243	151	1254	1473	299	66	865	1790
Total	91	91	8082	8081	394	394	13817	13810	365	365	11307	11309

^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.