

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2023

Fecha de Información: 15 de noviembre 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\$5377 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.96%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	979,3	1272,9	312,3	582,9	660,5	96,2	300,1
15-35	867,4	1032,8	691,9	496,2	17,1	47,4	323,8
36-60	178,2	296,3	135,0	109,8	106,3	13,5	55,0
61-90	124,7	12,5	0,0	31,1	12,5	93,6	0,0
91-180	380,7	496,4	431,5	0,0	13,9	329,7	51,0
>180	387,9	113,5	45,5	47,5	32,2	304,6	35,8
Total	2918,3	3224,4	1616,2	1267,5	842,5	885,1	765,7

^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	8.24%	7.41%	7.95%	7.73%
15-35	8.17%	7.62%	8.27%	7.99%
36-60	8.45%	8.51%	7.77%	8.46%
61-90	–	8.60%	8.16%	8.21%
91-180	8.29%	8.28%	8.02%	8.16%
>180	8.04%	8.25%	7.93%	7.99%
Total	8.22%	7.77%	8.06%	7.96%

^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

Sector	13 – 17 nov.				20 - 24 nov.				27 nov. - 01 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	65	164	6089	6404	36	256	7583	9467	177	294	5702	6747
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	3423	2877	0	0	5676	3898	0	0	3679	2244
Otros ^c	164	65	528	757	256	36	1424	1311	294	177	750	1141
Total	229	229	10040	10038	292	292	14683	14676	471	471	10131	10132

^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.