

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2023

Fecha de Información: 17 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\$4524 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.86%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	1052,4	1001,4	261,6	622,7	349,7	39,6	390,2
15-35	1132,2	1608,0	901,0	392,3	18,6	51,4	688,4
36-60	2,3	2,4	0,0	0,0	2,4	2,3	0,0
61-90	54,8	187,7	160,0	5,0	17,7	39,8	10,0
91-180	266,1	130,1	95,0	0,0	3,8	234,8	31,2
>180	122,7	133,6	60,0	25,0	23,6	47,7	50,0
Total	2630,4	3063,1	1477,6	1045,0	415,7	415,6	1169,8

^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	8.49%		6.60%	6.66%	7.20%
15-35	8.27%		8.36%	8.08%	8.28%
36-60	-		8.58%	7.88%	8.23%
61-90	8.35%		8.40%	7.84%	8.26%
91-180	8.24%		8.19%	7.88%	7.98%
>180	7.34%		7.74%	7.37%	7.49%
Total	8.30%		7.82%	7.42%	7.86%

^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	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	37	65	974	959	46	269	8861	10270	181	294	6247	7689
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	400	415	0	0	5989	4751	0	0	3965	2422
Otros ^c	65	37	63	63	269	46	1521	1344	294	181	1076	1178
Total	102	102	1437	1437	315	315	16371	16365	475	475	11288	11289

^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.