

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2023

Fecha de Información: 20 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\$3763 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.53%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1026,7	957,5	532,6	756,6	174,6	19,8	250,2
15-35	694,2	966,4	523,5	231,7	24,7	44,3	418,2
36-60	28,0	117,2	93,6	10,8	8,5	2,2	15,0
61-90	23,7	53,5	50,1	0,0	3,5	0,0	23,7
91-180	328,2	182,6	134,4	90,0	28,2	218,2	20,0
>180	55,3	74,9	56,5	32,2	0,4	5,1	18,0
Total	2156,0	2352,0	1390,8	1121,4	239,8	289,6	745,1

^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	8.73%		8.79%	8.33%	8.57%
15-35	8.73%		8.55%	8.54%	8.62%
36-60	8.50%		8.63%	8.22%	8.57%
61-90	-		8.27%	8.32%	8.29%
91-180	8.34%		8.14%	8.24%	8.21%
>180	7.91%		8.20%	8.18%	8.07%
Total	8.69%		8.60%	8.35%	8.53%

^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	20 – 24 nov.				27 nov. - 01 dic.				04 - 08 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	270	9623	10573	187	287	6635	8313	20	188	4545	6094
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6219	5322	0	0	4257	2634	0	0	4469	2537
Otros ^c	270	47	1528	1468	287	187	1243	1188	188	20	267	645
Total	317	317	17370	17363	474	474	12135	12135	208	208	9281	9276

^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.