

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2023
Fecha de Información: 21 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\$3671 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.31%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	306,6	820,5	560,1	187,5	162,6	21,3	97,8
15-35	865,6	1126,6	569,6	311,0	24,0	21,5	533,1
36-60	80,5	118,5	70,0	0,0	8,5	40,5	40,0
61-90	284,6	35,6	5,0	205,5	5,6	54,0	25,0
91-180	120,9	169,6	97,7	43,5	16,7	22,1	55,2
>180	399,8	223,3	91,0	164,5	2,3	105,3	130,0
Total	2058,0	2494,1	1393,4	912,1	219,6	264,8	881,1

^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	8.65%		7.45%	8.29%	7.98%
15-35	8.64%		8.66%	8.49%	8.63%
36-60	8.45%		8.69%	8.30%	8.40%
61-90	8.32%		8.46%	7.97%	8.12%
91-180	8.15%		8.03%	8.16%	8.08%
>180	7.88%		7.66%	7.79%	7.81%
Total	8.48%		8.27%	8.14%	8.31%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$. 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	39	249	8404	9483	189	287	6696	8520	21	188	4632	6239
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5954	4822	0	0	4292	2653	0	0	4519	2537
Otros ^c	249	39	1125	1172	287	189	1382	1197	188	21	288	657
Total	288	288	15483	15477	476	476	12370	12370	209	209	9439	9433

^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.