

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2023
Fecha de Información: 24 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\$1923 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.60%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	469,2	312,7	257,8	450,4	49,9	13,7	5,0
15-35	420,1	410,4	171,7	212,7	51,2	19,9	187,5
36-60	17,2	18,5	1,0	0,0	7,5	7,2	10,0
61-90	116,3	258,6	163,5	0,0	10,1	31,3	85,0
91-180	96,2	160,2	54,7	0,0	12,5	3,2	93,0
>180	5,1	19,5	4,0	1,8	15,5	3,4	0,0
Total	1124,0	1179,8	652,7	664,9	146,6	78,6	380,5

^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	8.81%	9.03%	8.86%	8.92%
15-35	8.74%	8.68%	7.87%	8.51%
36-60	8.67%	8.64%	8.29%	8.56%
61-90	8.32%	8.38%	8.19%	8.29%
91-180	8.11%	8.38%	7.84%	8.14%
>180	–	7.54%	7.72%	7.58%
Total	8.49%	8.76%	8.55%	8.60%

^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

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	22	164	925	1114	192	290	7565	9160	23	185	4762	6513
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	796	613	0	0	4585	3268	0	0	4734	2612
Otros ^c	164	22	103	89	290	192	1513	1235	185	23	302	667
Total	186	186	1824	1816	482	482	13663	13663	208	208	9798	9792

^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.