

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de diciembre de 2023

Fecha de Información: 29 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\$3649 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.87%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	789,2	638,2	376,3	706,4	199,4	20,3	62,5
15-35	456,5	731,4	456,6	266,7	141,8	56,8	133,0
36-60	7,2	31,1	15,0	0,0	16,1	7,2	0,0
61-90	63,5	44,0	5,0	5,0	39,0	58,5	0,0
91-180	187,7	82,1	47,5	103,5	14,6	64,2	20,0
>180	592,3	533,9	230,7	128,3	10,2	171,1	293,0
Total	2096,5	2060,7	1131,1	1209,8	421,1	378,2	508,5

^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	8.18%	8.11%	8.05%	8.08%
15-35	8.13%	7.86%	7.97%	7.93%
36-60	–	8.30%	7.59%	8.08%
61-90	–	7.94%	7.71%	7.80%
91-180	7.58%	7.72%	7.69%	7.69%
>180	7.36%	6.78%	7.52%	7.38%
Total	7.67%	7.94%	7.88%	7.87%

^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	27 nov. - 01 dic.				04 - 08 dic.				11 - 15 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	144	218	4671	5111	28	196	5560	7578	80	174	7074	8570
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2771	2525	0	0	5209	3226	0	0	5385	3692
Otros ^c	218	144	878	684	196	28	713	673	174	80	435	592
Total	362	362	8320	8320	224	224	11482	11477	254	254	12894	12854

^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.