

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de noviembre de 2023
Fecha de Información: 07 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\$3837 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.47%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	1389,9	953,6	445,4	943,1	88,2	26,8	420,0
15-35	407,9	1370,5	1128,9	144,2	64,1	86,2	177,5
36-60	22,2	55,0	20,0	0,0	18,0	5,2	17,0
61-90	30,9	27,2	0,0	0,0	21,2	24,9	6,0
91-180	107,3	16,8	0,0	0,0	6,8	97,3	10,0
>180	44,9	41,1	40,0	25,0	1,1	19,9	0,0
Total	2003,1	2464,2	1634,3	1112,3	199,4	260,2	630,5

^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	9.17%		5.86%	8.01%	8.07%
15-35	9.23%		8.81%	8.76%	8.86%
36-60	9.07%		9.04%	8.56%	9.01%
61-90	8.81%		8.91%	8.66%	8.78%
91-180	8.87%		8.99%	8.22%	8.32%
>180	-		7.29%	7.60%	7.44%
Total	9.17%		8.37%	8.15%	8.47%

^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	06 – 10 nov.				13 - 17 nov.				20 - 24 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	45	129	10495	11145	151	187	6709	7655	24	243	6351	7014
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5641	4249	0	0	3710	2569	0	0	4590	3298
Otros ^c	129	45	1320	1513	187	151	1539	1732	243	24	537	1159
Total	174	174	17456	16907	338	338	11958	11956	267	267	11478	11471

^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.