

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2023

Fecha de Información: 08 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\$2913 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.65%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	428,6	509,6	325,8	242,0	61,5	64,3	122,3
15-35	593,8	1016,9	715,9	272,3	22,0	42,5	279,0
36-60	46,9	47,1	30,0	0,0	5,1	34,9	12,0
61-90	140,5	22,2	0,0	55,0	18,7	82,0	3,5
91-180	11,4	93,3	80,0	0,0	2,8	0,9	10,5
>180	281,6	193,1	145,5	230,4	2,6	6,2	45,0
Total	1502,7	1882,2	1297,2	799,7	112,7	230,7	472,3

^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	9.87%		9.52%	8.72%	9.24%
15-35	9.48%		8.36%	8.72%	8.71%
36-60	9.06%		9.03%	9.08%	9.06%
61-90	9.20%		8.34%	8.90%	8.81%
91-180	8.80%		8.87%	8.50%	8.85%
>180	8.10%		6.29%	7.10%	7.08%
Total	9.42%		8.50%	8.37%	8.65%

^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	32	100	9601	9645	158	187	6920	7977	27	244	6469	7161
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4990	4121	0	0	3871	2650	0	0	4685	3344
Otros ^c	100	32	782	1065	187	158	1590	1753	244	27	550	1191
Total	132	132	15373	14831	345	345	12381	12380	271	271	11704	11696

^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.