

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2023
Fecha de Información: 09 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\$4447 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.08%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	986,0	832,0	488,9	707,5	164,0	99,5	179,0
15-35	837,7	1148,7	689,9	436,4	106,8	49,4	351,9
36-60	245,4	153,3	92,0	40,8	16,3	159,6	45,0
61-90	355,7	100,9	50,0	183,5	14,9	136,2	36,0
91-180	47,0	221,6	178,0	0,0	23,6	27,0	20,0
>180	48,7	107,0	101,8	38,5	0,3	5,2	5,0
Total	2520,5	2563,5	1600,6	1406,7	325,9	476,9	636,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	9.45%		9.72%	8.07%	8.76%
15-35	9.64%		9.56%	9.03%	9.43%
36-60	9.44%		7.95%	9.63%	9.02%
61-90	8.96%		9.16%	8.91%	8.97%
91-180	8.77%		8.81%	8.68%	8.79%
>180	8.53%		8.32%	8.01%	8.25%
Total	9.50%		9.29%	8.68%	9.08%

^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) ^ (365/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	18	54	6253	6700	160	188	7565	8520	29	245	6538	7382
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3909	3312	0	0	4072	3018	0	0	4883	3392
Otros ^c	54	18	384	506	188	160	1744	1841	245	29	560	1200
Total	72	72	10546	10518	348	348	13381	13379	274	274	11981	11974

^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.