

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2023

Fecha de Información: 16 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\$5019 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.00%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	1242,6	1082,8	551,1	754,5	88,6	45,1	443
15-35	753,7	1386,7	996,2	351,3	33,5	45,4	357
36-60	29,9	6,9	0,0	27,0	6,9	2,9	0
61-90	141,6	162,5	144,0	60,0	8,5	71,6	10
91-180	292,2	520,2	402,7	113,0	7,5	69,2	110
>180	288,7	181,1	2,8	104,2	28,2	34,5	150
Total	2748,7	3340,2	2096,9	1410,0	173,3	268,7	1070

^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	8.39%		8.16%	7.48%	8.03%
15-35	8.32%		8.03%	7.34%	8.03%
36-60	-		8.80%	8.33%	8.50%
61-90	8.35%		8.19%	8.20%	8.22%
91-180	8.17%		7.89%	8.10%	8.03%
>180	7.88%		6.47%	7.54%	7.61%
Total	8.27%		8.01%	7.60%	8.00%

^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	13 – 17 nov.				20 - 24 nov.				27 nov. - 01 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	56	106	4643	4814	41	256	8338	10021	178	294	6008	7125
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2531	2353	0	0	5875	4341	0	0	3894	2395
Otros ^c	106	56	366	373	256	41	1485	1330	294	178	777	1160
Total	162	162	7540	7540	297	297	15698	15692	472	472	10679	10680

^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.