

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2023**

**Fecha de Información: 16 de noviembre de 2023<sup>1</sup>**

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%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		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
<b>Total</b>	<b>2748,7</b>	<b>3340,2</b>	<b>2096,9</b>	<b>1410,0</b>	<b>173,3</b>	<b>268,7</b>	<b>1070</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		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%
<b>Total</b>	<b>8.27%</b>		<b>8.01%</b>	<b>7.60%</b>	<b>8.00%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>A 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.

<sup>2</sup>El 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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . 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 <sup>a</sup>	56	106	4643	4814	41	256	8338	10021	178	294	6008	7125
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2531	2353	0	0	5875	4341	0	0	3894	2395
Otros <sup>c</sup>	106	56	366	373	256	41	1485	1330	294	178	777	1160
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>7540</b>	<b>7540</b>	<b>297</b>	<b>297</b>	<b>15698</b>	<b>15692</b>	<b>472</b>	<b>472</b>	<b>10679</b>	<b>10680</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.