

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2023
Fecha de Información: 28 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\$4406 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.75%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	834,9	834,2	585,4	695,2	125,8	16,7	123
15-35	625,2	1126,7	739,3	306,6	92,5	23,6	295
36-60	4,5	17,5	0,0	0,0	17,5	4,5	0
61-90	41,7	294,1	262,6	0,0	31,5	41,7	0
91-180	589,1	97,4	10,3	513,3	32,1	20,8	55
>180	256,1	217,4	150,0	93,5	7,4	102,6	60
Total	2351,5	2587,3	1747,5	1608,6	306,7	210,0	533

^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	8.77%	7.13%	6.95%	7.30%
15-35	8.34%	7.90%	8.36%	8.12%
36-60	–	8.35%	7.79%	8.24%
61-90	–	7.98%	7.73%	7.87%
91-180	7.87%	8.06%	7.83%	7.90%
>180	7.60%	8.07%	6.87%	7.18%
Total	8.31%	7.65%	7.53%	7.75%

^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	27 nov. - 01 dic.				04 - 08 dic.				11 - 15 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	149	256	8087	9038	26	196	5116	7126	67	172	6855	8237
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	4759	3815	0	0	5026	2855	0	0	5158	3588
Otros ^c	256	149	1392	1385	196	26	515	671	172	67	432	580
Total	405	405	14238	14238	222	222	10657	10652	239	239	12445	12405

^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.