

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de diciembre de 2023

Fecha de Información: 30 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\$3490 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.65%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	732,3	749,5	413,1	364,6	24,0	55,3	312,4
15-35	551,7	842,7	565,0	293,9	37,3	17,4	240,4
36-60	207,1	241,5	90,0	50,0	17,5	23,1	134,0
61-90	178,5	337,5	163,4	2,0	9,0	11,5	165,0
91-180	264,9	117,8	36,0	185,2	16,8	14,7	65,0
>180	71,3	117,4	107,0	62,0	5,4	4,3	5,0
Total	2005,7	2406,3	1374,6	957,7	110,0	126,2	921,8

^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	8.14%		8.11%	6.44%	7.56%
15-35	8.05%		7.50%	7.54%	7.64%
36-60	8.01%		8.10%	7.94%	8.01%
61-90	7.79%		7.96%	7.42%	7.81%
91-180	7.59%		7.72%	7.52%	7.63%
>180	6.81%		6.59%	7.31%	6.66%
Total	7.99%		7.67%	7.09%	7.65%

^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	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	77	61	2903	3483	42	197	5926	7902	87	173	7135	8635
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1881	1398	0	0	5361	3396	0	0	5376	3693
Otros ^c	61	77	458	361	197	42	716	700	173	87	457	600
Total	138	138	5242	5242	239	239	12003	11998	260	260	12968	12928

^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.