

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 04 de diciembre 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\$4151 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.96%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	831,6	752,1	265,5	491,7	345,6	198,9	141
15-35	771,3	1050,4	576,0	351,9	101,4	46,5	373
36-60	80,2	227,3	115,0	48,5	90,3	9,7	22
61-90	69,6	22,6	10,0	68,1	12,6	1,5	0
91-180	364,1	128,2	118,2	55,1	10,0	309,0	0
>180	182,7	373,8	205,0	15,0	1,8	0,7	167
Total	2299,5	2554,4	1289,7	1030,3	561,8	566,2	703

^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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	8.26%		8.29%	7.73%	8.02%
15-35	8.34%		8.35%	7.91%	8.23%
36-60	8.12%		8.23%	8.15%	8.21%
61-90	-		7.97%	7.81%	7.96%
91-180	-		7.86%	7.44%	7.47%
>180	7.12%		7.32%	7.03%	7.22%
Total	8.03%		8.15%	7.72%	7.96%

^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 intragruppo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	04 – 08 dic.				11 - 15 dic.				18 - 22 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	203	7219	8742	205	174	7240	9379	38	339	8447	10028
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5978	4347	0	0	5606	3755	0	0	6214	4610
Otros ^c	203	47	726	829	174	205	947	620	339	38	1045	1068
Total	250	250	13923	13918	379	379	13793	13754	377	377	15706	15706

^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.