

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 05 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\$3732 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.18%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1074,1	791,6	502,7	900,3	174,4	59,3	114,5
15-35	549,9	1070,6	632,4	144,3	56,7	24,1	381,5
36-60	26,5	150,4	145,0	0,0	5,4	26,5	0,0
61-90	81,6	126,2	80,0	20,0	21,2	36,6	25,0
91-180	119,0	31,6	0,0	59,2	21,6	49,9	10,0
>180	157,9	211,9	82,3	28,9	0,9	0,3	128,7
Total	2009,0	2382,3	1442,4	1152,7	280,2	196,6	659,7

^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	8.66%		8.52%	7.54%	7.97%
15-35	8.76%		8.65%	7.93%	8.59%
36-60	-		8.29%	7.99%	8.25%
61-90	8.02%		7.58%	7.99%	7.77%
91-180	7.84%		7.89%	7.65%	7.74%
>180	7.34%		7.37%	5.73%	7.34%
Total	8.42%		8.43%	7.66%	8.18%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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	44	170	7012	7812	207	175	7505	9524	40	339	8536	10351
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5400	4425	0	0	5618	3960	0	0	6427	4622
Otros ^c	170	44	506	682	175	207	1023	622	339	40	1145	1135
Total	214	214	12918	12919	382	382	14146	14106	379	379	16108	16108

^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.