

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 06 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\$3343 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.09%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	759,8	644,1	220,2	458,0	133,1	11,0	290,8
15-35	757,2	1226,1	841,5	390,5	21,8	3,9	362,8
36-60	77,5	96,9	7,5	0,0	38,4	26,5	51,0
61-90	45,4	66,0	10,0	0,0	26,0	15,4	30,0
91-180	126,4	122,8	70,0	66,3	22,8	30,0	30,0
>180	35,6	175,1	145,0	0,0	5,1	10,6	25,0
Total	1801,9	2331,0	1294,2	914,9	247,2	97,5	789,6

^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	9.03%	8.54%	5.78%	7.57%
15-35	9.03%	8.69%	7.94%	8.65%
36-60	8.97%	8.63%	8.28%	8.70%
61-90	8.28%	8.25%	7.95%	8.20%
91-180	7.58%	6.90%	7.67%	7.28%
>180	7.44%	7.06%	6.25%	7.06%
Total	8.90%	8.31%	6.82%	8.09%

^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

Sector	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	32	142	5586	6334	208	177	7865	9891	41	342	8609	10552
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4363	3619	0	0	5751	4114	0	0	6470	4631
Otros ^c	142	32	420	415	177	208	1055	627	342	41	1245	1142
Total	174	174	10369	10368	385	385	14671	14632	383	383	16324	16325

^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.