

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 07 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\$2109 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.20%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	557,1	309,8	182,5	393,8	11,3	47,3	116,0
15-35	293,7	766,5	532,9	62,5	17,6	15,2	216,0
36-60	122,7	238,9	97,0	22,0	46,8	5,6	95,1
61-90	44,7	25,2	0,0	0,0	25,0	44,5	0,2
91-180	94,2	61,6	35,6	72,4	10,8	6,7	15,1
>180	33,1	12,4	0,0	21,0	4,4	4,1	8,0
Total	1145,4	1414,4	848,0	571,7	116,0	123,3	450,4

^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	9.14%	8.46%	6.43%	7.69%
15-35	8.96%	8.18%	8.59%	8.45%
36-60	8.49%	8.68%	8.85%	8.63%
61-90	8.07%	8.26%	7.91%	8.03%
91-180	7.69%	7.93%	7.64%	7.69%
>180	7.25%	12.08%	7.05%	7.94%
Total	8.83%	8.35%	7.28%	8.20%

^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	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	17	94	812	1069	227	179	8382	10142	41	342	8741	10755
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	828	550	0	0	5916	4535	0	0	6578	4659
Otros ^c	94	17	47	68	179	227	1058	639	342	41	1251	1157
Total	111	111	1687	1687	406	406	15356	15316	383	383	16570	16571

^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.