

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 12 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\$3730 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.74%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	847,7	429,4	196,4	717,6	218,2	115,2	14,8
15-35	716,2	1361,3	1060,3	443,3	44,0	15,9	257,0
36-60	69,7	36,7	1,0	50,0	27,7	11,7	8,0
61-90	99,2	42,8	2,0	60,0	20,8	19,2	20,0
91-180	49,4	98,8	78,0	25,0	20,8	24,4	0,0
>180	146,5	166,7	130,0	45,7	1,7	65,8	35,0
Total	1928,7	2135,7	1467,6	1341,6	333,2	252,2	334,8

^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	8.82%		9.43%	7.70%	8.30%
15-35	8.90%		7.57%	6.46%	7.51%
36-60	8.65%		8.49%	8.08%	8.42%
61-90	8.12%		8.08%	7.96%	8.01%
91-180	-		7.78%	7.58%	7.72%
>180	6.95%		7.12%	6.99%	7.04%
Total	8.64%		7.95%	7.20%	7.74%

^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	11 – 15 dic.				18 - 22 dic.				25 - 29 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	74	143	9058	9179	47	385	9048	11917	21	244	2511	3521
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5334	5462	0	0	7451	4835	0	0	2056	1414
Otros ^c	143	74	936	656	385	47	1429	1175	244	21	684	316
Total	217	217	15328	15297	432	432	17928	17927	265	265	5251	5251

^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.