

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 14 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\$3982 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.15%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	404,5	346,8	290,0	349,1	0,0	0,0	55,4
15-35	1223,6	658,4	480,2	1039,8	24,8	30,5	153,3
36-60	553,7	31,4	0,0	500,0	31,4	53,7	0,0
61-90	31,5	106,1	40,0	5,0	41,1	1,4	25,0
91-180	180,5	394,3	345,5	60,0	48,8	120,5	0,0
>180	95,0	239,9	184,6	27,0	5,3	18,0	50,0
Total	2488,8	1776,9	1340,4	1980,9	151,5	224,2	283,7

^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	8.74%	8.72%	8.48%	8.55%
15-35	8.57%	8.64%	7.90%	8.35%
36-60	–	8.83%	7.99%	8.30%
61-90	8.06%	7.80%	7.83%	7.86%
91-180	–	7.67%	7.63%	7.64%
>180	7.55%	7.38%	6.67%	7.35%
Total	8.35%	8.27%	7.95%	8.15%

^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	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	49	82	4276	3978	52	515	9786	12456	26	244	2572	3574
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2491	2751	0	0	7914	5501	0	0	2075	1456
Otros ^c	82	49	306	339	515	52	1443	1186	244	26	708	325
Total	131	131	7073	7068	567	567	19143	19143	270	270	5355	5355

^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.