

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 15 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\$2642 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.56%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	492,2	290,5	214,6	437,3	67,1	46,2	8,8
15-35	333,4	503,4	451,7	264,6	16,7	33,8	35,0
36-60	56,9	169,0	60,0	0,0	109,0	56,9	0,0
61-90	6,2	215,9	165,1	0,7	45,8	0,5	5,0
91-180	108,9	191,7	144,5	90,0	47,2	18,9	0,0
>180	198,8	123,3	112,2	135,9	11,1	62,9	0,0
Total	1196,5	1493,8	1148,2	928,5	296,9	219,2	48,8

^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	8.27%		8.16%	7.94%	8.03%
15-35	8.12%		7.51%	6.37%	7.14%
36-60	-		8.02%	7.76%	7.93%
61-90	7.94%		7.90%	7.46%	7.89%
91-180	-		7.69%	6.54%	7.26%
>180	-		7.10%	7.40%	7.28%
Total	8.13%		7.76%	7.27%	7.56%

^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

Sector	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	16	39	407	608	54	523	10083	12746	27	247	2634	3597
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	416	172	0	0	8107	5699	0	0	2075	1509
Otros ^c	39	16	118	157	523	54	1475	1221	247	27	731	334
Total	55	55	941	937	577	577	19665	19666	274	274	5440	5440

^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.