

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 18 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\$2146 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.91%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	586,7	390,3	301,3	500,2	12,4	10,1	76,5
15-35	391,3	600,4	463,5	261,6	14,9	7,7	122,0
36-60	93,1	107,6	0,0	20,0	47,6	13,1	60,0
61-90	0,2	15,8	0,0	0,0	15,8	0,2	0,0
91-180	34,2	154,3	126,0	21,8	28,3	12,5	0,0
>180	3,6	27,3	13,3	3,5	14,0	0,1	0,0
Total	1109,2	1295,5	904,0	807,1	133,0	43,6	258,5

^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	8.05%		7.89%	7.77%	7.88%
15-35	7.93%		7.93%	7.80%	7.89%
36-60	8.00%		8.30%	7.76%	8.09%
61-90	-		8.11%	7.46%	8.10%
91-180	-		7.83%	7.47%	7.76%
>180	-		7.84%	6.31%	7.83%
Total	7.98%		7.95%	7.77%	7.91%

^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	18 – 22 dic.				25 - 29 dic.				01 - 05 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	54	524	10544	12871	29	247	2729	3749	9	94	3396	5782
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	8222	6108	0	0	2212	1589	0	0	3976	1738
Otros ^c	524	54	1479	1266	247	29	733	337	94	9	273	124
Total	578	578	20245	20245	276	276	5674	5675	103	103	7645	7644

^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.