

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 19 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\$2827 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.92%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	556,3	149,5	76,5	412,1	40,7	112,0	32,3
15-35	651,2	1170,8	815,6	297,2	25,7	24,4	329,5
36-60	28,9	174,1	10,0	10,0	152,1	6,9	12,0
61-90	112,2	131,3	73,7	60,0	17,6	12,2	40,0
91-180	26,7	118,2	73,0	0,0	45,2	26,7	0,0
>180	101,9	55,6	10,0	65,9	10,2	0,5	35,4
Total	1477,1	1799,5	1058,8	845,3	291,5	182,7	449,2

^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	7.89%		8.09%	8.52%	8.39%
15-35	7.93%		7.90%	7.82%	7.89%
36-60	7.76%		7.53%	7.51%	7.54%
61-90	7.81%		7.85%	7.67%	7.82%
91-180	-		7.97%	7.60%	7.83%
>180	7.21%		7.68%	6.98%	7.22%
Total	7.85%		7.86%	8.07%	7.92%

^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	50	484	6757	8348	30	254	2784	3822	11	96	3627	5847
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4839	3534	0	0	2260	1627	0	0	3976	1904
Otros ^c	484	50	1090	803	254	30	759	354	96	11	276	129
Total	534	534	12686	12685	284	284	5803	5803	107	107	7879	7880

^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.