

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 20 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\$2484 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.96%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 | 686,7 | 125,3 | 99,3 | 668,0 | 16,0 | 8,7 | 10,0 |
| 15-35 | 327,0 | 929,8 | 666,3 | 113,0 | 62,5 | 13,0 | 201,0 |
| 36-60 | 53,2 | 108,1 | 51,4 | 0,0 | 14,0 | 10,5 | 42,7 |
| 61-90 | 12,1 | 315,4 | 287,5 | 0,3 | 17,9 | 1,8 | 10,0 |
| 91-180 | 97,4 | 34,3 | 0,0 | 93,3 | 34,3 | 4,2 | 0,0 |
| >180 | 15,6 | 47,7 | 36,7 | 10,2 | 6,0 | 0,4 | 5,0 |
| Total | 1192,1 | 1560,7 | 1141,3 | 884,8 | 150,7 | 38,6 | 268,7 |

^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 | 7.79% | 8.69% | 8.00% | 8.10% |
| 15-35 | 7.98% | 7.96% | 7.83% | 7.95% |
| 36-60 | 7.48% | 8.18% | 7.60% | 7.65% |
| 61-90 | 7.78% | 7.85% | 7.41% | 7.80% |
| 91-180 | – | 7.86% | 7.39% | 7.81% |
| >180 | 7.26% | 7.49% | 6.61% | 7.45% |
| Total | 7.87% | 8.00% | 7.95% | 7.96% |

^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 | 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 | 44 | 199 | 5574 | 6347 | 30 | 261 | 2861 | 3851 | 13 | 97 | 3633 | 5851 |
| Intragruppo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3690 | 2994 | 0 | 0 | 2285 | 1698 | 0 | 0 | 3976 | 1906 |
| Otros ^c | 199 | 44 | 840 | 762 | 261 | 30 | 762 | 360 | 97 | 13 | 276 | 129 |
| Total | 243 | 243 | 10104 | 10103 | 291 | 291 | 5908 | 5909 | 110 | 110 | 7885 | 7886 |

^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.