

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 22 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\$2147 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.68%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	359,4	115,7	52,5	309,6	17,2	3,9	46,0
15-35	763,1	966,2	416,2	210,5	29,5	32,1	520,5
36-60	7,5	193,2	179,3	0,0	13,9	7,5	0,0
61-90	9,4	140,2	104,2	0,0	36,0	9,4	0,0
91-180	13,4	37,7	1,5	11,8	36,2	1,6	0,0
>180	39,6	67,7	42,5	30,0	25,2	9,6	0,0
Total	1192,5	1520,7	796,2	561,9	157,9	64,1	566,5

^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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	7.80%		10.53%	7.75%	8.14%
15-35	7.90%		7.60%	5.62%	7.57%
36-60	-		8.02%	7.67%	7.98%
61-90	-		7.88%	7.55%	7.81%
91-180	-		7.73%	7.52%	7.72%
>180	-		7.49%	3.11%	6.55%
Total	7.90%		7.94%	6.91%	7.68%

^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 intragruppo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	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	8	62	1465	1783	31	273	3184	4067	16	101	3831	5942
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1135	780	0	0	2434	1953	0	0	4066	2100
Otros ^c	62	8	49	86	273	31	783	381	101	16	278	133
Total	70	70	2649	2649	304	304	6401	6401	117	117	8175	8175

^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.