

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 26 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\$2000 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.92%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	430,2	188,9	112,0	292,2	14,9	76,0	62
15-35	350,2	357,5	245,3	291,7	72,3	18,5	40
36-60	66,7	232,0	150,0	0,0	82,0	66,7	0
61-90	112,4	176,5	147,6	111,8	28,8	0,6	0
91-180	68,3	64,4	13,1	10,0	51,3	58,3	0
>180	16,3	48,8	15,5	6,3	23,2	0,0	10
Total	1044,1	1068,0	683,5	712,1	272,5	220,1	112

^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	7.62%		7.83%	4.86%	5.69%
15-35	7.45%		7.81%	6.32%	7.23%
36-60	-		7.46%	7.49%	7.47%
61-90	-		7.85%	7.27%	7.84%
91-180	-		7.77%	7.35%	7.54%
>180	6.99%		7.40%	-	7.28%
Total	7.50%		7.68%	6.02%	6.92%

^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

Sector	25 – 29 dic.				01 - 05 ene.				08 - 12 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	274	3516	4146	16	108	3937	6038	67	148	4928	6248
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2470	2163	0	0	4136	2179	0	0	4191	2195
Otros ^c	274	31	788	465	108	16	280	136	148	67	326	483
Total	305	305	6774	6774	124	124	8353	8353	215	215	9445	8926

^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.