

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de enero de 2024
Fecha de Información: 27 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\$2535 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.48%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	340,8	124,8	69,8	271,5	15,0	29,3	40
15-35	788,6	588,3	399,1	671,7	131,2	58,8	58
36-60	57,6	88,8	35,0	55,0	53,8	2,6	0
61-90	62,4	174,0	139,8	28,0	34,2	34,4	0
91-180	102,4	90,3	5,0	24,5	75,3	67,9	10
>180	86,6	163,0	114,3	55,2	23,7	6,4	25
Total	1438,3	1229,3	763,0	1106,0	333,3	199,4	133

^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	7.48%		11.55%	7.17%	7.98%
15-35	7.40%		7.49%	7.27%	7.37%
36-60	-		7.74%	7.36%	7.72%
61-90	-		7.80%	7.39%	7.54%
91-180	7.50%		7.49%	7.39%	7.45%
>180	7.52%		7.46%	6.51%	7.35%
Total	7.45%		7.73%	7.26%	7.48%

^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	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	29	234	1854	2149	35	111	4174	6103	77	157	5011	6287
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1015	992	0	0	4147	2365	0	0	4191	2236
Otros ^c	234	29	609	336	111	35	284	137	157	77	330	490
Total	263	263	3478	3477	146	146	8605	8605	234	234	9532	9013

^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.