

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de enero de 2024
Fecha de Información: 28 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\$1795 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.28%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	201,4	152,2	87,9	143,0	24,3	18,4	40,0
15-35	421,4	572,4	394,0	279,9	74,8	37,9	103,6
36-60	1,6	52,9	0,0	0,0	52,9	1,6	0,0
61-90	146,9	61,4	16,1	140,0	45,4	6,9	0,0
91-180	115,3	159,2	103,2	85,0	46,1	20,3	10,0
>180	33,5	45,8	5,0	18,1	25,8	0,4	15,0
Total	920,1	1043,9	606,1	666,0	269,2	85,5	168,6

^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	7.15%		6.67%	3.45%	5.03%
15-35	7.34%		6.05%	5.63%	6.08%
36-60	-		7.51%	6.84%	7.49%
61-90	-		7.60%	7.03%	7.52%
91-180	7.36%		7.45%	7.31%	7.39%
>180	7.18%		7.53%	6.68%	7.25%
Total	7.28%		6.65%	5.44%	6.28%

^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	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	13	102	652	848	38	115	4297	6162	85	161	5054	6335
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	381	342	0	0	4196	2484	0	0	4211	2253
Otros ^c	102	13	262	104	115	38	294	140	161	85	338	496
Total	115	115	1295	1294	153	153	8787	8786	246	246	9603	9084

^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.