

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de enero de 2024
Fecha de Información: 04 de enero de 2024¹

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\$2508 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.52%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	533,7	216,6	102,4	412,6	6,2	13,2	108
15-35	434,6	1039,8	705,0	143,2	93,8	50,4	241
36-60	102,3	5,9	0,0	0,0	5,9	102,3	0
61-90	52,8	67,9	60,4	50,0	7,4	2,8	0
91-180	169,5	36,7	3,9	120,0	17,8	34,5	15
>180	105,2	127,4	102,8	80,9	4,6	4,4	20
Total	1398,2	1494,3	974,4	806,6	135,8	207,6	384

^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	7.55%		7.57%	7.48%	7.51%
15-35	7.53%		7.60%	7.45%	7.56%
36-60	-		7.90%	7.40%	7.43%
61-90	-		7.59%	7.28%	7.51%
91-180	7.48%		7.57%	7.38%	7.41%
>180	7.39%		7.18%	6.90%	7.24%
Total	7.53%		7.58%	7.43%	7.52%

^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	01 – 05 ene.				08 - 12 ene.				15 - 19 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	15	63	3518	3829	96	165	5826	6712	32	226	3973	5528
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2455	2233	0	0	4491	2835	0	0	3884	1813
Otros ^c	63	15	211	122	165	96	348	598	226	32	531	1047
Total	78	78	6184	6184	261	261	10665	10145	258	258	8388	8388

^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.