

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2024

Fecha de Información: 05 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\$1751 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.11%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	421,4	221,7	134,1	332,6	12,6	13,8	75,0
15-35	459,5	419,4	248,5	319,3	47,8	17,1	123,1
36-60	74,0	56,3	0,0	0,0	16,3	34,0	40,0
61-90	26,3	25,8	19,5	12,2	6,4	14,1	0,0
91-180	22,1	20,9	0,9	5,0	20,1	17,1	0,0
>180	106,2	136,2	126,3	93,2	8,9	11,9	1,1
Total	1109,4	880,4	529,2	762,3	112,0	108,0	239,1

^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	7.65%		7.63%	7.10%	7.38%
15-35	7.69%		6.66%	6.82%	6.93%
36-60	7.73%		7.83%	7.43%	7.63%
61-90	-		7.48%	7.29%	7.36%
91-180	-		7.80%	7.29%	7.56%
>180	5.78%		7.15%	6.64%	6.85%
Total	7.67%		6.99%	6.94%	7.11%

^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	12	40	712	772	99	161	6066	6906	32	229	4198	5554
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	497	503	0	0	4620	3013	0	0	3889	2014
Otros ^c	40	12	78	12	161	99	353	600	229	32	537	1056
Total	52	52	1287	1287	260	260	11039	10519	261	261	8624	8624

^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.