

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2024

Fecha de Información: 12 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\$3565 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.12%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	764,3	595,7	236,5	428,0	46,2	23,3	313,0
15-35	837,9	1198,7	810,8	515,2	81,6	16,5	306,2
36-60	8,2	17,4	0,0	0,0	17,4	8,2	0,0
61-90	94,1	215,4	105,0	0,0	28,4	12,1	82,0
91-180	124,0	123,0	55,0	36,5	16,0	35,5	52,0
>180	189,7	219,7	95,0	89,5	54,7	30,2	70,0
Total	2018,2	2369,9	1302,3	1069,2	244,4	125,8	823,2

^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	7.37%		7.22%	6.55%	6.96%
15-35	7.30%		7.27%	7.13%	7.25%
36-60	-		7.77%	7.26%	7.61%
61-90	7.25%		7.42%	7.11%	7.32%
91-180	7.13%		6.87%	7.00%	7.00%
>180	6.53%		7.11%	6.90%	6.87%
Total	7.25%		7.25%	6.79%	7.12%

^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	08 – 12 ene.				15 - 19 ene.				22 - 26 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	16	72	537	545	39	262	5091	6868	46	247	3784	4861
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	308	278	1	0	4373	2599	0	0	2821	1379
Otros ^c	72	16	87	104	261	39	1113	1111	247	46	622	984
Total	88	88	932	927	301	301	10577	10578	293	293	7227	7224

^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.