

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2024
Fecha de Información: 16 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\$2712 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.58%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	597,3	539,1	249,7	372,0	87,5	23,3	202,0
15-35	589,2	802,1	544,7	317,0	18,3	33,0	239,1
36-60	97,0	110,1	55,0	30,0	9,8	21,7	45,2
61-90	59,9	2,4	0,0	0,0	2,4	59,9	0,0
91-180	75,5	91,0	75,0	39,1	11,0	31,4	5,0
>180	31,0	234,9	202,3	2,4	6,4	2,4	26,2
Total	1449,9	1779,6	1126,6	760,5	135,4	171,9	517,6

^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	7.75%		7.71%	7.51%	7.65%
15-35	7.72%		7.77%	7.68%	7.74%
36-60	7.69%		7.65%	7.27%	7.59%
61-90	-		7.58%	7.16%	7.17%
91-180	7.37%		7.39%	7.08%	7.21%
>180	6.83%		6.65%	6.73%	6.68%
Total	7.68%		7.57%	7.50%	7.58%

^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	15 – 19 ene.				22 - 26 ene.				29 ene. - 02 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	41	273	5729	7002	50	249	3896	5129	30	185	5055	5421
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4428	3020	0	0	2952	1383	0	0	3658	2588
Otros ^c	272	41	1113	1248	249	50	661	994	185	30	630	1335
Total	314	314	11270	11270	299	299	7509	7506	215	215	9343	9344

^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.