

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de enero de 2024
Fecha de Información: 17 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\$2584 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.70%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	510,6	319,0	248,9	409,5	19,7	50,6	50,5
15-35	492,1	1009,9	785,7	252,5	11,7	27,1	212,5
36-60	72,1	55,0	35,0	20,0	10,0	42,1	10,0
61-90	34,6	6,8	0,0	29,0	6,8	5,6	0,0
91-180	62,5	89,3	50,0	0,0	24,3	47,5	15,0
>180	130,5	157,3	85,0	45,0	4,3	17,5	68,0
Total	1302,4	1637,3	1204,6	756,0	76,7	190,4	356,0

^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	8.80%	8.03%	7.74%	7.89%
15-35	8.13%	7.85%	7.13%	7.78%
36-60	7.75%	7.95%	7.43%	7.68%
61-90	–	7.70%	7.34%	7.54%
91-180	7.49%	7.62%	7.50%	7.56%
>180	7.02%	6.71%	6.66%	6.80%
Total	7.97%	7.78%	7.46%	7.70%

^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

Sector	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	29	154	4223	4675	51	249	3930	5364	31	186	5080	5437
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3247	2533	0	0	3173	1388	0	0	3669	2591
Otros ^c	154	29	417	659	249	51	673	1020	186	31	636	1356
Total	183	183	7887	7867	300	300	7776	7772	217	217	9385	9384

^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.