

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2024
Fecha de Información: 18 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\$3810 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.76%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	643,1	676,1	332,2	539,5	248,9	8,6	95
15-35	1123,5	1087,0	715,1	496,7	13,9	268,8	358
36-60	15,6	14,3	6,0	6,0	8,3	9,6	0
61-90	43,5	69,4	50,0	25,0	9,4	8,5	10
91-180	68,1	195,9	118,8	0,0	37,1	28,1	40
>180	184,0	287,1	175,3	75,0	16,8	14,0	95
Total	2077,8	2329,7	1397,3	1142,3	334,4	337,6	598

^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	7.99%		3.17%	5.91%	4.87%
15-35	8.25%		7.60%	7.09%	7.57%
36-60	-		8.23%	7.92%	8.07%
61-90	7.73%		7.80%	7.34%	7.68%
91-180	7.67%		7.32%	7.26%	7.39%
>180	6.89%		6.80%	6.49%	6.76%
Total	7.94%		6.19%	6.72%	6.76%

^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	17	110	3238	3572	53	251	4206	5741	31	187	5300	5642
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2423	1972	0	0	3267	1616	0	0	3814	2757
Otros ^c	110	17	319	416	251	53	910	1023	187	31	646	1360
Total	127	127	5980	5960	304	304	8383	8380	218	218	9760	9759

^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.