

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2024

Fecha de Información: 19 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\$1557 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.09%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	148,4	195,9	121,2	123,0	59,6	10,4	15,0
15-35	386,9	573,5	409,2	233,2	0,0	38,7	115,0
36-60	26,3	75,8	50,0	0,0	13,8	14,2	12,1
61-90	29,0	47,7	30,0	10,0	7,7	9,0	10,0
91-180	58,1	63,4	0,0	30,0	43,4	8,1	20,0
>180	121,4	88,0	0,0	35,0	3,0	1,4	85,0
Total	770,1	1044,3	610,5	431,2	127,4	81,8	257,1

^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	8.44%		8.81%	8.16%	8.51%
15-35	8.36%		8.37%	7.72%	8.19%
36-60	8.04%		8.17%	8.08%	8.14%
61-90	7.79%		7.86%	7.74%	7.78%
91-180	7.66%		7.66%	7.47%	7.64%
>180	7.26%		7.19%	6.86%	7.17%
Total	7.91%		8.36%	7.77%	8.09%

^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	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	8	53	389	527	55	262	4433	5942	32	192	5317	5719
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	455	288	0	0	3360	1754	0	0	3861	2760
Otros ^c	53	8	47	77	262	55	935	1028	192	32	664	1363
Total	61	61	891	892	317	317	8728	8724	224	224	9842	9842

^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.