

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2024

Fecha de Información: 22 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\$4938 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.92%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	831,9	1124,1	654,4	500,7	253,7	115,1	216,0
15-35	1112,6	1144,6	561,9	600,2	94,2	23,9	488,5
36-60	235,6	172,6	65,2	128,0	7,4	7,6	100,0
61-90	0,4	10,0	0,0	0,0	10,0	0,4	0,0
91-180	653,0	424,7	200,0	218,7	25,7	235,2	199,0
>180	160,3	221,6	57,8	10,0	13,8	0,3	150,0
Total	2993,8	3097,5	1539,3	1457,7	404,7	382,6	1153,5

^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	8.29%		7.59%	7.48%	7.69%
15-35	8.41%		8.37%	8.41%	8.40%
36-60	8.02%		8.74%	7.99%	8.05%
61-90	-		7.88%	7.59%	7.87%
91-180	7.75%		7.70%	7.46%	7.62%
>180	7.17%		7.12%	6.57%	7.16%
Total	8.08%		7.90%	7.75%	7.92%

^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

Sectores	22 – 26 ene.				29 ene. - 02 feb.				05 - 09 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	57	265	4935	6710	34	192	5489	6085	46	107	4547	5543
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3766	2023	0	0	4137	2847	0	0	3470	1986
Otros ^c	265	57	1186	1150	192	34	691	1384	107	46	589	1033
Total	322	322	9887	9883	226	226	10317	10316	153	153	8606	8562

^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.