

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2024
Fecha de Información: 23 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\$4080 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.72%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	526,6	817,0	241,1	287,5	378,4	41,5	197,5
15-35	911,1	676,2	459,3	660,0	13,4	47,6	203,5
36-60	176,6	328,0	275,0	100,0	32,7	56,3	20,3
61-90	26,5	22,2	0,0	15,0	22,2	11,5	0,0
91-180	450,4	449,5	446,0	0,0	3,5	450,4	0,0
>180	65,6	72,7	50,0	35,9	2,1	9,1	20,6
Total	2156,7	2365,5	1471,4	1098,4	452,3	616,4	441,9

^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	8.71%		5.17%	8.58%	6.76%
15-35	8.54%		8.78%	8.57%	8.63%
36-60	8.16%		8.25%	7.95%	8.20%
61-90	-		8.03%	7.86%	7.97%
91-180	-		7.87%	7.34%	7.51%
>180	6.70%		6.86%	6.61%	6.77%
Total	8.51%		7.14%	8.09%	7.72%

^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	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	49	235	4601	5864	37	194	5658	6593	49	107	4566	5620
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3208	1830	0	0	4227	2936	0	0	3537	1986
Otros ^c	235	49	1002	1113	194	37	1058	1413	107	49	589	1043
Total	284	284	8811	8807	231	231	10943	10942	156	156	8692	8649

^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.