

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2024
Fecha de Información: 24 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\$3340 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.21%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	632,1	245,1	124,5	535,9	30,6	6,2	90,0
15-35	838,2	927,3	643,8	479,5	14,0	89,2	269,5
36-60	245,1	326,0	192,2	95,0	18,8	35,1	115,0
61-90	29,8	15,6	0,0	0,0	15,6	29,8	0,0
91-180	70,0	292,9	269,0	36,0	23,9	34,0	0,0
>180	109,1	122,9	77,0	64,6	5,9	4,5	40,0
Total	1924,2	1929,8	1306,5	1211,0	108,8	198,6	514,5

^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	8.60%		8.66%	8.37%	8.44%
15-35	7.89%		8.48%	8.40%	8.31%
36-60	7.78%		8.07%	7.75%	7.94%
61-90	-		8.04%	7.80%	7.88%
91-180	-		7.77%	7.47%	7.63%
>180	7.02%		7.16%	6.98%	7.04%
Total	7.92%		8.34%	8.27%	8.21%

^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	14	183	4092	4791	38	194	5804	6752	49	107	4582	5690
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2668	1872	0	0	4314	3026	0	0	3591	1996
Otros ^c	183	14	696	789	194	38	1078	1418	107	49	599	1043
Total	197	197	7456	7452	232	232	11196	11196	156	156	8772	8729

^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.