

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de enero de 2024

Fecha de Información: 25 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\$4021 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.68%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	551,1	589,8	172,0	325,0	216,8	25,1	201,0
15-35	901,7	955,6	655,0	578,2	4,7	27,6	295,9
36-60	334,0	245,4	208,5	265,0	6,9	39,0	30,0
61-90	23,3	4,5	0,0	10,0	4,5	13,3	0,0
91-180	338,4	593,5	469,6	0,0	23,9	238,4	100,0
>180	77,7	42,8	30,5	30,5	2,3	37,2	10,0
Total	2226,1	2431,6	1535,6	1208,7	259,1	380,5	636,9

^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	7.70%		7.98%	7.81%	7.85%
15-35	7.84%		7.96%	7.79%	7.85%
36-60	7.77%		7.74%	7.66%	7.72%
61-90	-		7.90%	7.36%	7.50%
91-180	7.42%		7.45%	7.29%	7.39%
>180	6.75%		6.91%	6.74%	6.79%
Total	7.71%		7.73%	7.59%	7.68%

^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	12	138	3158	3515	38	191	6019	7198	50	111	4746	5778
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1785	1406	0	0	4446	3119	0	0	3597	2076
Otros ^c	138	12	530	547	191	38	1292	1439	111	50	601	1046
Total	150	150	5473	5468	229	229	11757	11756	161	161	8944	8900

^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.