

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2024
Fecha de Información: 26 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\$4152 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.06%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	471,5	889,9	213,1	128,5	346,0	12,1	330,9
15-35	1439,4	1199,6	382,6	641,9	36,0	16,5	781,0
36-60	335,3	235,4	60,0	160,0	10,4	10,3	165,0
61-90	11,5	9,8	0,0	0,0	9,8	11,5	0,0
91-180	383,0	368,5	290,0	0,0	28,5	333,0	50,0
>180	64,2	126,2	65,0	0,0	6,2	9,2	55,0
Total	2704,9	2829,4	1010,7	930,4	436,8	392,6	1381,9

^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	7.80%	5.98%	5.77%	6.69%
15-35	7.79%	5.70%	7.55%	7.23%
36-60	7.69%	7.78%	5.64%	7.06%
61-90	–	7.87%	7.25%	7.53%
91-180	7.26%	7.33%	7.00%	7.11%
>180	7.16%	7.08%	6.37%	7.06%
Total	7.74%	6.21%	7.00%	7.06%

^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	5	59	783	972	41	192	6405	7681	52	113	4830	6184
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	463	296	0	0	4641	3212	0	0	3610	2105
Otros ^c	59	5	103	77	192	41	1290	1443	113	52	941	1049
Total	64	64	1349	1345	233	233	12336	12336	165	165	9381	9338

^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.