

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2024
Fecha de Información: 29 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\$3171 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.87%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	757,0	420,3	164,0	391,5	5,3	114,5	251,0
15-35	1028,6	1202,7	536,5	527,0	204,2	39,6	462,0
36-60	122,0	172,5	90,0	40,0	12,5	12,0	70,0
61-90	25,0	124,3	110,0	0,4	4,3	14,6	10,0
91-180	1,2	6,4	0,0	0,0	6,4	1,2	0,0
>180	20,6	87,7	77,9	15,0	5,2	1,0	4,6
Total	1954,5	2013,8	978,3	973,9	237,9	183,0	797,6

^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	7.35%		7.51%	4.97%	6.28%
15-35	7.41%		6.61%	7.00%	7.00%
36-60	7.56%		7.48%	7.51%	7.51%
61-90	7.27%		7.30%	7.24%	7.29%
91-180	-		7.75%	6.66%	7.57%
>180	6.95%		6.68%	3.76%	6.66%
Total	7.40%		6.86%	6.33%	6.87%

^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	29 ene. - 02 feb.				05 - 09 feb.				12 - 16 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	43	193	7082	8042	64	115	5068	6304	90	149	6222	7462
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4745	3478	0	0	3653	2263	0	0	4586	2423
Otros ^c	193	43	1325	1631	115	64	943	1054	149	90	442	1360
Total	236	236	13152	13151	179	179	9664	9621	239	239	11250	11245

^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.