

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de febrero de 2024

Fecha de Información: 30 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\$3926 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.03%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	845,1	969,3	364,4	453,5	236,2	23,0	368,6
15-35	864,6	1109,4	453,0	258,0	113,5	63,7	542,9
36-60	296,9	216,3	71,4	131,5	19,1	39,6	125,8
61-90	52,6	116,2	65,7	0,0	19,8	21,8	30,7
91-180	271,6	107,1	70,0	0,0	24,1	258,5	13,0
>180	109,7	73,0	40,9	81,5	7,1	3,2	25,0
Total	2440,4	2591,3	1065,4	924,5	419,9	409,9	1106,0

^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	7.36%		6.12%	6.59%	6.66%
15-35	7.35%		7.46%	7.21%	7.35%
36-60	7.35%		7.38%	7.31%	7.36%
61-90	7.20%		7.30%	7.19%	7.25%
91-180	7.25%		7.08%	6.73%	6.83%
>180	6.75%		6.69%	6.66%	6.71%
Total	7.34%		6.82%	6.88%	7.03%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})} - 1)$. 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	41	106	5994	6835	64	115	5335	6723	91	150	6442	7676
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3910	2776	0	0	3656	2334	0	0	4674	2508
Otros ^c	106	41	1054	1346	115	64	1178	1067	150	91	444	1371
Total	147	147	10958	10957	179	179	10169	10124	241	241	11560	11555

^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.