

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de febrero de 2024

Fecha de Información: 31 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\$3235 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.96%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	962,5	413,4	253,8	800,4	6,6	9,1	153,0
15-35	775,0	1246,9	926,0	435,6	17,9	36,4	303,0
36-60	25,3	58,0	20,0	0,0	23,0	10,3	15,0
61-90	52,2	52,2	31,0	0,0	11,2	42,2	10,0
91-180	7,1	44,6	20,0	0,0	23,1	5,6	1,5
>180	31,3	54,6	48,0	25,0	1,6	1,3	5,0
Total	1853,4	1869,6	1298,8	1261,0	83,3	104,9	487,5

^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	7.30%		6.40%	7.24%	7.12%
15-35	7.07%		7.05%	6.29%	6.86%
36-60	7.02%		7.32%	7.06%	7.22%
61-90	6.99%		7.14%	6.87%	7.00%
91-180	7.06%		7.14%	6.92%	7.10%
>180	6.02%		6.17%	5.70%	6.14%
Total	7.13%		6.96%	6.89%	6.96%

^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	35	71	5447	5547	66	117	5535	6929	91	151	6755	7838
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3505	3216	0	0	3789	2459	0	0	4724	2705
Otros ^c	71	35	475	663	117	66	1178	1071	151	91	449	1380
Total	106	106	9427	9426	183	183	10502	10459	242	242	11928	11923

^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.