

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de febrero de 2024
Fecha de Información: 01 de febrero 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\$2834 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.09%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	638,1	326,0	51,7	443,8	120,7	40,7	153,6
15-35	593,6	498,4	381,8	486,0	48,2	39,2	68,5
36-60	130,0	54,0	0,0	24,8	54,0	105,2	0,0
61-90	40,1	50,3	10,7	40,0	39,6	0,1	0,0
91-180	223,0	463,7	302,2	99,0	62,6	25,0	99,0
>180	30,0	128,0	95,9	8,4	11,3	0,9	20,8
Total	1655,0	1520,5	842,2	1101,9	336,4	211,2	341,9

^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	7.23%	7.20%	7.54%	7.35%
15-35	6.88%	7.05%	7.02%	7.02%
36-60	–	7.36%	6.98%	7.10%
61-90	–	7.27%	6.18%	6.72%
91-180	6.99%	7.07%	6.98%	7.03%
>180	6.80%	6.63%	5.81%	6.68%
Total	7.07%	7.09%	7.09%	7.09%

^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	12	41	4052	4121	66	119	6092	7126	97	156	6914	8001
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2470	2201	0	0	3837	2828	0	0	4756	2828
Otros ^c	41	12	289	475	119	66	1189	1105	156	97	555	1380
Total	53	53	6811	6797	185	185	11118	11059	253	253	12225	12209

^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.