

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de febrero de 2024
Fecha de Información: 02 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\$3319 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.08%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	705,5	379,9	121,5	433,7	2,4	15,8	256,0
15-35	714,9	1440,5	924,7	196,4	12,3	15,0	503,5
36-60	253,2	5,0	0,0	240,0	5,0	13,2	0,0
61-90	161,8	146,6	55,0	60,2	6,6	16,5	85,0
91-180	4,5	14,5	10,0	0,0	4,5	4,5	0,0
>180	128,6	236,0	204,4	99,2	3,6	1,5	28,0
Total	1968,5	2222,5	1315,7	1029,6	34,4	66,5	872,5

^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	7.29%		7.21%	5.99%	6.66%
15-35	7.28%		7.49%	6.60%	7.31%
36-60	-		7.25%	6.79%	6.92%
61-90	7.06%		7.11%	7.07%	7.07%
91-180	-		7.04%	6.84%	6.94%
>180	6.57%		6.09%	5.89%	6.29%
Total	7.24%		7.40%	6.28%	7.08%

^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	7	22	893	1016	74	119	6570	7305	100	156	7029	8127
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	654	529	0	0	3931	3221	0	0	4770	2828
Otros ^c	22	7	37	38	119	74	1190	1106	156	100	555	1385
Total	29	29	1584	1583	193	193	11691	11632	256	256	12354	12340

^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.