

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de febrero de 2024
Fecha de Información: 05 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\$5694 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.20%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	306,9	566,1	280,7	170,2	167,4	18,7	118,0
15-35	2906,5	1350,7	429,0	372,3	409,2	2021,7	512,5
36-60	316,3	141,4	7,8	63,5	13,6	132,8	120,0
61-90	63,8	117,9	100,0	14,1	7,9	39,7	10,0
91-180	533,0	23,8	10,0	0,0	3,8	523,0	10,0
>180	41,8	101,4	95,1	32,5	1,2	4,2	5,0
Total	4168,3	2301,3	922,7	652,6	603,1	2740,2	775,5

^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	7.56%		6.37%	7.43%	6.82%
15-35	7.68%		7.14%	7.30%	7.32%
36-60	7.50%		7.26%	7.31%	7.39%
61-90	7.26%		7.28%	7.11%	7.23%
91-180	7.02%		7.17%	6.80%	6.81%
>180	6.82%		6.16%	6.93%	6.36%
Total	7.62%		6.90%	7.21%	7.20%

^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	05 - 09 feb.				12 - 16 feb.				19 - 23 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	76	120	6767	7621	103	161	7124	8399	28	206	8263	6405
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4123	3295	0	0	4821	2851	0	0	3828	3327
Otros ^c	120	76	1194	1111	161	103	713	1393	206	28	739	3067
Total	196	196	12084	12027	264	264	12658	12643	234	234	12830	12799

^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.