

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de febrero de 2024
Fecha de Información: 06 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\$4332 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.86%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	878,6	909,5	347,5	460,6	242,0	98,0	320,0
15-35	862,2	1337,1	475,0	224,0	272,0	48,1	590,1
36-60	139,8	111,0	0,0	10,5	101,0	119,3	10,0
61-90	178,6	20,6	11,0	45,0	9,6	133,6	0,0
91-180	283,6	21,8	0,5	0,0	21,3	283,6	0,0
>180	353,7	429,7	147,4	60,5	8,3	19,2	274,0
Total	2696,5	2829,7	981,5	800,6	654,2	701,8	1194,1

^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	7.72%		7.70%	7.24%	7.55%
15-35	7.76%		5.10%	7.62%	6.48%
36-60	7.49%		7.73%	7.59%	7.65%
61-90	-		7.34%	7.28%	7.28%
91-180	-		7.38%	6.02%	6.12%
>180	6.38%		6.43%	5.34%	6.33%
Total	7.43%		6.17%	7.03%	6.86%

^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	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	62	108	6487	7162	105	162	7582	8928	30	204	8504	6680
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3911	3080	0	0	4931	3119	0	0	3874	3337
Otros ^c	108	62	1152	1256	162	105	953	1405	204	30	742	3071
Total	170	170	11550	11498	267	267	13466	13452	234	234	13120	13088

^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.