

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2024
Fecha de Información: 08 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\$2440 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.23%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	505,4	549,2	375,6	336,2	13,4	9,1	160,1
15-35	654,9	870,6	426,0	205,8	4,5	9,0	440,1
36-60	11,8	5,2	0,5	0,0	4,7	11,8	0,0
61-90	93,3	80,4	60,0	58,1	20,4	35,2	0,0
91-180	6,8	94,8	82,0	0,0	12,8	6,8	0,0
>180	122,1	86,0	45,0	82,0	1,0	0,1	40,0
Total	1394,4	1686,2	989,1	682,1	56,8	72,1	640,2

^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	7.59%		5.70%	6.71%	6.57%
15-35	7.85%		7.78%	6.71%	7.60%
36-60	-		7.89%	7.40%	7.55%
61-90	-		7.45%	7.38%	7.43%
91-180	-		7.30%	7.04%	7.24%
>180	6.70%		6.74%	5.61%	6.72%
Total	7.71%		7.03%	6.80%	7.23%

^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	25	53	4118	4401	102	162	8516	9833	31	204	6688	7087
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2399	2040	0	0	5503	3676	0	0	4069	3353
Otros ^c	53	25	492	527	162	102	967	1463	204	31	798	1084
Total	78	78	7009	6968	264	264	14986	14972	235	235	11555	11524

^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.