

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2024
Fecha de Información: 09 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\$1820 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.40%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	292,8	405,1	225,8	158,2	51,7	7,1	127,6
15-35	654,7	429,5	154,5	358,9	33,0	53,7	242,0
36-60	34,9	19,0	0,0	16,8	19,0	18,1	0,0
61-90	83,7	106,6	72,7	0,0	13,8	63,7	20,0
91-180	11,7	70,2	45,1	0,0	17,0	3,7	8,0
>180	53,3	86,5	52,5	22,1	4,0	1,2	30,0
Total	1131,1	1116,8	550,6	556,0	138,5	147,5	427,6

^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	7.61%		7.65%	6.50%	7.31%
15-35	7.57%		7.55%	7.52%	7.55%
36-60	-		7.81%	7.35%	7.59%
61-90	7.29%		7.43%	7.28%	7.31%
91-180	7.03%		7.19%	7.08%	7.16%
>180	6.41%		6.77%	6.27%	6.54%
Total	7.48%		7.53%	7.21%	7.40%

^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	18	32	288	385	104	172	8756	10077	34	205	6769	7238
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	274	184	0	0	5654	3851	0	0	4133	3353
Otros ^c	32	18	68	36	172	104	1001	1468	205	34	808	1087
Total	50	50	630	605	276	276	15411	15396	239	239	11710	11678

^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.