

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2024
Fecha de Información: 12 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\$2283 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.78%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	431,2	362,2	225,4	286,7	8,2	15,9	128,6
15-35	719,6	563,7	248,5	418,7	25,7	11,4	289,5
36-60	33,1	45,5	10,0	0,0	19,5	17,1	16,0
61-90	47,4	30,4	0,9	10,0	9,5	17,4	20,0
91-180	4,4	34,1	10,3	0,0	23,8	4,4	0,0
>180	367,0	418,8	92,0	47,0	6,8	0,0	320,0
Total	1602,7	1454,7	587,1	762,4	93,5	66,1	774,1

^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	7.02%	7.01%	5.95%	6.50%
15-35	7.01%	7.01%	7.01%	7.01%
36-60	7.08%	7.37%	7.10%	7.22%
61-90	6.82%	7.48%	6.95%	7.00%
91-180	–	7.27%	6.90%	7.21%
>180	6.67%	6.52%	–	6.65%
Total	6.87%	6.99%	6.50%	6.78%

^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	12 – 16 feb.				19 - 23 feb.				26 feb. - 01 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	105	173	9083	10326	35	207	6852	7320	22	240	8246	8393
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5870	4138	0	0	4133	3353	0	0	4519	3994
Otros ^c	173	105	1004	1479	207	35	811	1091	240	22	896	1259
Total	278	278	15957	15943	242	242	11796	11764	262	262	13661	13646

^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.