

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2024
Fecha de Información: 13 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\$2850 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.62%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	414,8	433,5	390,3	373,3	7,2	5,5	36
15-35	752,8	918,5	596,9	432,3	22,6	21,4	299
36-60	92,6	70,4	33,5	35,0	4,9	25,6	32
61-90	71,4	179,2	171,2	50,0	3,0	16,3	5
91-180	2,1	87,0	75,0	0,0	12,0	2,1	0
>180	163,8	44,2	35,8	155,5	0,4	0,4	8
Total	1497,4	1732,8	1302,6	1046,1	50,1	71,3	380

^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	7.05%		5.87%	5.98%	6.03%
15-35	6.97%		6.87%	6.23%	6.76%
36-60	7.12%		7.43%	6.38%	6.71%
61-90	7.01%		7.00%	6.94%	6.99%
91-180	-		7.10%	6.67%	7.09%
>180	6.41%		7.21%	6.94%	6.89%
Total	6.98%		6.69%	6.27%	6.62%

^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	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	86	141	8061	9206	36	207	6912	7476	24	240	8261	8523
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5535	4160	0	0	4282	3403	0	0	4625	3994
Otros ^c	141	86	743	960	207	36	811	1096	240	24	904	1259
Total	227	227	14339	14326	243	243	12005	11975	264	264	13790	13776

^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.