

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2024
Fecha de Información: 14 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\$3209 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.50%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	815,6	215,5	66,0	656,8	73,5	82,9	76,0
15-35	764,6	1294,9	715,9	137,8	93,0	140,8	486,0
36-60	134,8	170,0	69,5	51,0	23,9	7,2	76,6
61-90	174,8	121,8	80,2	135,6	6,6	4,2	35,0
91-180	111,9	26,8	18,0	0,0	8,8	111,9	0,0
>180	42,3	24,6	2,4	24,3	7,2	3,0	15,0
Total	2044,0	1853,6	952,0	1005,4	212,9	350,0	688,6

^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	7.10%		6.55%	4.84%	5.31%
15-35	7.10%		6.97%	7.01%	7.02%
36-60	7.10%		7.20%	7.04%	7.10%
61-90	6.98%		7.07%	6.96%	7.04%
91-180	-		7.16%	6.84%	6.87%
>180	6.09%		6.43%	6.12%	6.17%
Total	7.07%		6.93%	5.72%	6.50%

^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	72	123	7707	8165	36	211	7095	7607	24	241	8405	8591
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4900	4308	0	0	4327	3545	0	0	4657	4107
Otros ^c	123	72	673	793	211	36	867	1107	241	24	910	1260
Total	195	195	13280	13266	247	247	12289	12259	265	265	13972	13958

^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.