

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2024
Fecha de Información: 15 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\$2398 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.70%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	266,5	360,9	323,5	219,0	27,2	37,2	10,3
15-35	931,8	1233,9	536,1	205,4	8,5	37,2	689,3
36-60	28,1	12,6	0,2	0,0	12,4	28,1	0,0
61-90	52,9	49,1	10,0	31,0	19,1	1,9	20,0
91-180	108,1	50,1	20,0	15,0	25,1	88,1	5,0
>180	21,6	12,1	0,0	0,0	7,1	16,6	5,0
Total	1408,9	1718,7	889,8	470,4	99,3	209,0	729,5

^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	6.27%	6.96%	5.04%	6.13%
15-35	6.91%	6.87%	6.81%	6.88%
36-60	–	7.27%	6.87%	7.00%
61-90	6.88%	6.93%	6.90%	6.91%
91-180	6.75%	6.75%	6.65%	6.68%
>180	6.74%	6.55%	6.14%	6.35%
Total	6.89%	6.90%	6.19%	6.70%

^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	48	86	5495	5793	36	215	7115	7724	25	241	8477	8677
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3759	3403	0	0	4442	3545	0	0	4714	4152
Otros ^c	86	48	475	512	215	36	870	1127	241	25	929	1277
Total	134	134	9729	9708	251	251	12427	12396	266	266	14120	14106

^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.