

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2024
Fecha de Información: 16 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\$3267 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.76%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	425,5	480,6	259,8	250,8	58,0	11,9	162,9
15-35	993,7	1464,2	606,8	273,7	184,8	47,4	672,6
36-60	16,5	18,2	0,0	0,0	18,2	16,5	0,0
61-90	232,4	111,7	0,0	100,0	16,7	37,4	95,0
91-180	314,3	137,3	41,2	10,0	29,1	237,3	67,0
>180	50,0	60,0	11,3	0,0	8,7	10,0	40,0
Total	2032,4	2272,0	919,1	634,5	315,4	360,5	1037,4

^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	6.87%		7.00%	6.72%	6.87%
15-35	6.90%		6.57%	6.91%	6.76%
36-60	-		7.16%	6.65%	6.92%
61-90	6.82%		7.12%	6.81%	6.83%
91-180	6.72%		6.77%	6.48%	6.57%
>180	6.56%		6.01%	5.88%	6.31%
Total	6.86%		6.68%	6.72%	6.76%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$. 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	15	51	853	902	43	221	7225	7952	26	242	8799	8935
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	637	567	0	0	4611	3594	0	0	4805	4349
Otros ^c	51	15	56	67	221	43	876	1126	242	26	975	1281
Total	66	66	1546	1536	264	264	12712	12672	268	268	14579	14565

^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.