

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de marzo de 2024
Fecha de Información: 04 de marzo 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\$2804 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.36%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	791,5	441,2	287,7	630,1	9,0	16,8	144,5
15-35	663,6	801,6	497,0	352,5	12,6	19,1	292,0
36-60	133,3	138,5	17,5	0,6	9,3	21,0	111,7
61-90	1,7	41,8	33,2	0,0	8,6	1,7	0,0
91-180	35,4	124,7	94,6	0,0	5,0	10,4	25,0
>180	65,5	138,3	136,3	60,3	2,1	5,2	0,0
Total	1691,0	1686,1	1066,4	1043,5	46,5	74,3	573,2

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ¹		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	6.67%		5.19%	6.19%	6.07%
15-35	6.58%		6.62%	6.44%	6.57%
36-60	6.57%		6.63%	6.01%	6.49%
61-90	-		6.52%	5.43%	6.34%
91-180	6.32%		6.31%	6.15%	6.30%
>180	-		6.10%	5.65%	5.78%
Total	6.59%		6.28%	6.25%	6.36%

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.

³Cifras en millones de dólares

²Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

³Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

¹Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	04 - 08 mar.				11 - 15 mar.				18 - 22 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	124	8209	8565	69	135	5432	6154	36	211	10350	11369
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4113	3549	0	0	3439	2423	0	0	6497	4918
Otros ^c	124	44	548	753	135	69	444	712	211	36	620	1168
Total	168	168	12870	12867	204	204	9315	9289	247	247	17467	17455

^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.