

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2024
Fecha de Información: 08 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\$2089 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.88%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	504,5	394,3	92,0	212,4	22,6	12,5	279,6
15-35	541,8	520,9	227,5	285,0	52,9	16,4	240,5
36-60	28,5	198,8	160,3	1,5	28,5	17,0	10,0
61-90	45,0	35,6	0,0	0,0	15,6	25,0	20,0
91-180	147,3	81,2	10,0	116,0	41,2	1,3	30,0
>180	95,0	136,4	70,0	30,0	6,4	5,0	60,0
Total	1362,2	1367,2	559,8	644,9	167,3	77,2	640,1

^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	6.24%	6.19%	3.61%	5.98%
15-35	6.23%	4.80%	6.15%	5.80%
36-60	6.22%	6.56%	6.17%	6.38%
61-90	6.28%	6.62%	6.13%	6.30%
91-180	6.25%	6.24%	5.26%	5.63%
>180	5.86%	6.01%	5.89%	5.94%
Total	6.20%	5.62%	5.71%	5.88%

^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	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	9	32	1371	1398	75	150	6246	7075	39	218	11537	12150
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	726	680	0	0	3808	2868	0	0	6678	5470
Otros ^c	32	9	35	54	150	75	642	729	218	39	669	1254
Total	41	41	2132	2132	225	225	10696	10672	257	257	18884	18874

^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.