

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2024
Fecha de Información: 11 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\$3578 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.97%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	380,2	1170,4	990,5	319,7	132,9	13,6	47,0
15-35	556,1	376,7	162,2	347,0	21,5	16,1	193,0
36-60	663,8	151,8	40,4	504,7	16,4	64,1	95,0
61-90	21,6	8,0	0,0	0,0	8,0	21,6	0,0
91-180	272,7	140,9	9,0	21,7	21,9	141,0	110,0
>180	128,5	176,7	149,0	98,9	3,1	5,0	24,6
Total	2022,9	2024,4	1351,2	1292,0	203,7	261,4	469,6

^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	6.05%	5.74%	5.85%	5.79%
15-35	6.13%	6.34%	6.03%	6.13%
36-60	6.25%	6.46%	4.47%	5.70%
61-90	–	6.42%	6.13%	6.20%
91-180	6.17%	6.32%	6.17%	6.19%
>180	5.93%	6.05%	6.04%	6.02%
Total	6.14%	5.95%	5.87%	5.97%

^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	11 – 15 mar.				18 - 22 mar.				25 - 29 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	77	151	6487	7535	43	221	11912	13018	26	190	1673	2099
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4179	3020	0	0	7321	5740	0	0	838	611
Otros ^c	151	77	647	732	221	43	794	1259	190	26	425	226
Total	228	228	11313	11287	264	264	20027	20017	216	216	2936	2936

^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.