

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2024
Fecha de Información: 13 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\$4376 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.73%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	1202,4	951,1	369,6	736,0	153,5	38,4	428,0
15-35	700,9	1549,4	1100,6	262,8	34,8	24,1	414,0
36-60	160,9	116,2	0,0	56,9	14,5	2,4	101,7
61-90	99,9	11,8	0,0	0,0	11,8	99,9	0,0
91-180	101,5	111,8	14,6	60,4	57,2	1,1	40,0
>180	186,9	187,2	161,9	154,5	4,8	11,9	20,5
Total	2452,6	2927,5	1646,7	1270,6	276,7	177,8	1004,1

^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	6.21%	5.57%	4.52%	5.26%
15-35	6.23%	6.00%	6.22%	6.10%
36-60	6.23%	6.86%	6.09%	6.31%
61-90	–	6.46%	6.21%	6.23%
91-180	6.18%	6.19%	5.93%	6.18%
>180	5.79%	5.76%	5.80%	5.77%
Total	6.21%	5.90%	5.07%	5.73%

^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	71	105	4680	5491	44	229	12760	14135	26	190	1723	2231
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3001	1902	0	0	7681	6145	0	0	878	611
Otros ^c	105	71	473	737	229	44	1148	1296	190	26	471	230
Total	176	176	8154	8130	273	273	21589	21576	216	216	3072	3072

^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.