

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2024
Fecha de Información: 14 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\$3480 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.19%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	313,3	464,3	155,7	134,6	203,3	73,5	105,3
15-35	994,7	1172,3	506,8	345,2	30,9	14,8	634,7
36-60	203,6	237,9	40,0	40,0	40,3	6,0	157,6
61-90	48,7	240,4	191,6	0,0	13,8	13,7	35,0
91-180	421,1	155,8	81,8	233,9	38,2	151,3	35,9
>180	90,7	165,6	97,5	25,0	8,1	5,7	60,0
Total	2072,1	2436,4	1073,4	778,7	334,6	265,0	1028,4

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	6.63%		5.05%	6.07%	5.55%
15-35	6.50%		6.54%	6.49%	6.50%
36-60	6.56%		6.91%	6.55%	6.61%
61-90	6.47%		6.56%	6.19%	6.48%
91-180	6.23%		6.29%	6.04%	6.14%
>180	5.79%		5.68%	5.21%	5.65%
Total	6.47%		5.77%	6.24%	6.19%

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.

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	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	69	81	2701	3080	44	236	12998	14563	27	191	1764	2276
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1807	1192	0	0	7835	6233	0	0	881	611
Otros ^c	81	69	312	528	236	44	1340	1366	191	27	475	233
Total	150	150	4820	4800	280	280	22173	22162	218	218	3120	3120

^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.