

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2024
Fecha de Información: 18 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\$3124 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%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	459,6	443,4	309,4	323,0	49,0	51,6	85,0
15-35	597,3	1404,7	916,7	254,9	195,7	50,1	292,3
36-60	33,2	98,0	23,5	0,0	49,5	8,2	25,0
61-90	111,6	17,4	0,0	0,0	17,4	111,6	0,0
91-180	96,8	77,2	0,1	30,0	57,2	46,8	20,0
>180	90,5	166,4	102,9	40,0	13,4	0,5	50,0
Total	1389,0	2207,0	1352,6	647,9	382,2	268,9	472,3

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	6.83%	5.97%	6.24%	6.22%
15-35	6.83%	6.79%	6.75%	6.80%
36-60	6.86%	6.90%	6.64%	6.87%
61-90	–	6.78%	6.63%	6.65%
91-180	6.62%	6.46%	6.37%	6.43%
>180	6.31%	6.09%	6.28%	6.19%
Total	6.77%	6.53%	6.43%	6.55%

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	18 - 22 mar.				25 - 29 mar.				01 - 05 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	49	241	13967	15257	28	197	1821	2373	116	131	6137	7155
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	8322	6934	0	0	910	611	0	0	4002	2723
Otros ^c	241	49	1445	1531	197	28	502	251	131	116	411	664
Total	290	290	23734	23722	225	225	3233	3235	247	247	10550	10542

^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.