

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2024
Fecha de Información: 19 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\$4209 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.43%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	934,6	464,5	311,6	798,1	26,4	10,0	126,4
15-35	999,3	1477,4	795,8	397,6	101,6	21,7	580,0
36-60	334,2	477,9	125,6	0,0	67,0	48,9	285,2
61-90	130,6	66,9	8,1	0,0	32,5	104,3	26,2
91-180	78,7	95,7	14,5	0,0	51,2	48,7	30,0
>180	86,8	150,9	94,1	46,2	16,8	0,6	40,0
Total	2564,1	2733,1	1349,7	1242,0	295,5	234,3	1087,9

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	6.81%	7.14%	5.21%	5.60%
15-35	6.90%	6.63%	6.77%	6.74%
36-60	6.84%	6.86%	6.88%	6.85%
61-90	6.67%	6.79%	6.66%	6.69%
91-180	6.59%	6.63%	6.35%	6.52%
>180	6.05%	5.89%	6.26%	6.02%
Total	6.83%	6.66%	5.79%	6.43%

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	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	38	205	10768	11020	29	200	2008	2394	117	135	6438	7501
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5727	5378	0	0	911	787	0	0	4021	2780
Otros ^c	205	38	1251	1336	200	29	522	260	135	117	496	665
Total	243	243	17746	17734	229	229	3441	3441	252	252	10955	10946

^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.