

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2024
Fecha de Información: 20 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\$2663 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.60%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	415,9	428,4	312,5	266,8	9,7	42,9	106,2
15-35	816,5	849,3	461,5	429,8	66,8	65,8	321,0
36-60	171,0	153,9	41,5	0,0	8,4	67,0	104,0
61-90	24,2	25,8	13,3	14,9	12,5	9,3	0,0
91-180	48,6	50,4	0,0	20,9	25,4	2,7	25,0
>180	152,7	149,1	77,2	81,9	5,0	3,9	66,9
Total	1629,1	1656,8	905,9	814,3	127,8	191,7	623,1

^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	6.90%	6.96%	5.87%	6.46%
15-35	7.03%	6.43%	6.84%	6.74%
36-60	6.89%	6.89%	6.74%	6.84%
61-90	–	6.81%	6.63%	6.76%
91-180	6.56%	6.34%	6.57%	6.49%
>180	5.73%	5.77%	6.18%	5.92%
Total	6.83%	6.55%	6.46%	6.60%

^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	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	35	183	9569	9705	29	203	2180	2551	108	104	6232	7136
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5081	4795	0	0	999	876	0	0	3833	2788
Otros ^c	183	35	1114	1253	203	29	529	279	104	108	492	627
Total	218	218	15764	15753	232	232	3708	3706	212	212	10557	10551

^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.