

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2024
Fecha de Información: 21 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\$3751 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.83%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	765,0	926,3	493,2	481,2	228,1	78,7	205,0
15-35	856,8	895,8	346,7	296,8	23,0	34,0	526,1
36-60	25,9	50,7	9,9	0,0	24,9	10,0	15,9
61-90	110,4	107,5	61,8	64,8	30,7	30,6	15,0
91-180	440,0	161,7	70,0	89,4	46,7	305,6	45,0
>180	112,8	187,1	90,4	28,5	14,1	1,6	82,7
Total	2310,9	2329,2	1072,1	960,8	367,5	460,5	889,6

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	6.33%		4.62%	5.59%	5.24%
15-35	6.43%		6.52%	6.41%	6.45%
36-60	6.46%		6.68%	6.33%	6.54%
61-90	6.40%		6.53%	6.37%	6.47%
91-180	6.25%		6.28%	5.92%	6.04%
>180	5.72%		6.03%	5.67%	5.80%
Total	6.34%		5.36%	5.88%	5.83%

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	11	138	7437	7804	30	203	2369	2734	121	134	6918	8134
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4197	3829	0	0	1126	969	0	0	4329	3147
Otros ^c	138	11	631	631	203	30	531	323	134	121	751	706
Total	149	149	12265	12264	233	233	4026	4026	255	255	11998	11987

^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.