

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2024

Fecha de Información: 19 de febrero 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\$764 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.26%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	318,1	246,6	104,0	173,2	2,6	4,9	140
15-35	150,3	287,6	144,4	10,8	8,2	4,6	135
36-60	19,9	13,4	0,0	10,0	4,4	0,9	9
61-90	0,6	2,1	0,0	0,0	2,1	0,6	0
91-180	5,5	7,8	0,0	0,0	2,8	0,5	5
>180	0,4	0,5	0,0	0,0	0,5	0,4	0
Total	494,8	558,1	248,4	194,0	20,7	11,8	289

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	6.06%	6.39%	6.90%	6.30%
15-35	5.99%	6.59%	6.21%	6.30%
36-60	1.70%	7.01%	6.59%	4.86%
61-90	–	7.08%	6.67%	6.99%
91-180	6.41%	7.15%	6.56%	6.67%
>180	–	6.54%	6.61%	6.57%
Total	5.90%	6.53%	6.76%	6.26%

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	19 – 23 feb.				26 feb. - 01 mar.				04 - 08 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	43	221	7393	7968	27	243	8878	9109	20	120	5990	6476
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4626	3760	0	0	4908	4356	0	0	3163	2429
Otros ^c	221	43	877	1127	243	27	976	1283	120	20	395	639
Total	264	264	12896	12855	270	270	14762	14748	140	140	9548	9544

^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.