

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2024
Fecha de Información: 20 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\$3892 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.66%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	492,4	693,6	257,6	141,2	162,5	77,6	273,5
15-35	755,4	1073,1	561,5	207,6	24,6	60,9	487,0
36-60	410,4	253,3	20,9	151,9	32,4	58,4	200,0
61-90	285,9	179,3	91,7	4,2	7,6	201,7	80,0
91-180	309,2	20,4	0,0	217,0	15,3	87,0	5,1
>180	194,2	336,1	266,6	100,6	4,2	28,3	65,3
Total	2447,5	2555,8	1198,3	822,5	246,6	514,0	1111,0

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	6.78%	6.78%	6.66%	6.76%
15-35	6.78%	6.66%	6.70%	6.72%
36-60	6.76%	6.80%	6.48%	6.66%
61-90	6.62%	6.54%	6.61%	6.60%
91-180	6.45%	6.72%	6.54%	6.56%
>180	6.24%	6.04%	5.73%	6.06%
Total	6.73%	6.65%	6.58%	6.66%

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	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	7696	8224	29	245	9098	9502	25	121	6191	6792
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4723	3885	0	0	5007	4376	0	0	3307	2455
Otros ^c	221	43	917	1181	245	29	1093	1305	121	25	395	642
Total	264	264	13336	13290	274	274	15198	15183	146	146	9893	9889

^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.