

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2024
Fecha de Información: 21 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\$3505 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.61%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	378,3	614,1	335,2	191,4	119,5	27,5	159,5
15-35	1248,2	1272,2	486,2	400,3	21,5	83,3	764,5
36-60	445,5	235,0	1,0	20,0	7,0	198,5	227,0
61-90	69,2	78,4	29,8	20,0	3,6	4,2	45,0
91-180	109,0	18,8	0,0	0,0	18,8	109,0	0,0
>180	104,3	183,2	126,5	45,8	1,7	3,5	55,0
Total	2354,4	2401,8	978,7	677,5	172,1	426,0	1251,0

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	6.72%		6.72%	6.61%	6.70%
15-35	6.71%		6.62%	6.64%	6.67%
36-60	6.66%		6.71%	6.58%	6.62%
61-90	6.44%		6.53%	6.46%	6.48%
91-180	-		6.65%	6.32%	6.37%
>180	6.13%		6.01%	6.10%	6.05%
Total	6.67%		6.58%	6.56%	6.61%

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	34	172	5382	5887	30	246	9244	9870	26	121	6213	6836
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3592	3048	0	0	5158	4430	0	0	3336	2462
Otros ^c	172	34	457	476	246	30	1241	1328	121	26	397	644
Total	206	206	9431	9411	276	276	15643	15628	147	147	9946	9942

^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.