

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2024

Fecha de Información: 26 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\$2487 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.71%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	576,5	608,1	201,4	160,6	4,7	13,9	402
15-35	865,2	815,7	197,8	237,5	29,9	39,7	588
36-60	168,8	182,2	20,7	10,0	36,5	33,8	125
61-90	86,6	179,2	99,7	10,0	4,5	1,6	75
91-180	45,7	57,9	20,0	15,0	7,9	0,7	30
>180	40,6	110,0	80,0	6,5	0,0	4,1	30
Total	1783,5	1953,1	619,6	439,6	83,5	93,8	1250

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	7.04%		6.77%	6.47%	6.88%
15-35	6.74%		6.79%	6.61%	6.73%
36-60	6.59%		6.68%	6.51%	6.59%
61-90	6.42%		6.44%	6.14%	6.43%
91-180	6.41%		6.43%	6.19%	6.42%
>180	6.28%		6.25%	5.44%	6.21%
Total	6.78%		6.65%	6.53%	6.71%

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	26 feb. - 01 mar.				04 - 08 mar.				11 - 15 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	36	254	9995	10916	31	123	6582	7256	61	132	4760	5566
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5835	4814	0	0	3458	2518	0	0	3139	2040
Otros ^c	254	36	1335	1420	123	31	401	664	132	61	393	659
Total	290	290	17165	17150	154	154	10441	10438	193	193	8292	8265

^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.