

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de febrero de 2024
Fecha de Información: 27 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\$3723 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.27%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	967,8	685,1	271,8	611,8	157,3	100,0	256
15-35	657,4	885,0	509,3	406,7	164,8	39,8	211
36-60	170,3	117,1	54,2	10,0	12,9	110,3	50
61-90	60,7	50,7	35,1	50,0	5,6	0,7	10
91-180	133,8	82,4	61,6	22,2	15,8	106,6	5
>180	267,0	193,7	140,8	181,4	36,9	69,5	16
Total	2257,1	2014,0	1072,7	1282,1	393,2	427,0	548

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	6.76%		6.73%	5.42%	6.12%
15-35	6.74%		6.40%	6.05%	6.36%
36-60	6.54%		5.91%	6.49%	6.47%
61-90	6.32%		6.33%	6.29%	6.32%
91-180	6.30%		6.41%	6.52%	6.47%
>180	5.86%		6.34%	6.34%	6.30%
Total	6.69%		6.50%	5.91%	6.27%

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	33	213	9448	9924	33	124	6847	7665	62	133	4799	5613
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5435	4834	0	0	3597	2644	0	0	3139	2055
Otros ^c	213	33	1231	1342	124	33	532	665	133	62	418	662
Total	246	246	16114	16100	157	157	10976	10974	195	195	8356	8330

^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.