

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de marzo de 2024
Fecha de Información: 28 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\$3079 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.07%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	558,8	311,9	204,8	439,2	6,6	19,1	100,5
15-35	570,5	692,6	437,0	292,6	51,6	73,9	204,0
36-60	34,7	56,8	21,0	0,0	15,8	14,7	20,0
61-90	48,1	260,8	239,2	10,0	11,5	28,1	10,0
91-180	206,9	157,2	95,0	122,9	12,2	34,0	50,0
>180	475,9	219,1	79,9	339,3	9,2	6,7	130,0
Total	1895,0	1698,3	1077,0	1204,0	106,9	176,5	514,5

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	6.16%		6.39%	6.20%	6.23%
15-35	6.17%		6.02%	6.01%	6.05%
36-60	6.14%		6.35%	6.22%	6.27%
61-90	6.22%		5.92%	6.15%	6.12%
91-180	6.09%		6.23%	5.88%	6.05%
>180	5.72%		5.79%	5.31%	5.63%
Total	6.04%		6.10%	6.06%	6.07%

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	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	26	190	4739	4892	34	125	7013	7802	62	133	5054	5758
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2777	2609	0	0	3718	2795	0	0	3239	2238
Otros ^c	190	26	589	602	125	34	535	666	133	62	421	691
Total	216	216	8105	8103	159	159	11266	11263	195	195	8714	8687

^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.