

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de marzo de 2024
Fecha de Información: 29 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\$3935 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.55%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	910,1	678,9	389,8	590,5	7,1	37,6	282
15-35	1031,9	1514,3	736,6	356,0	113,7	11,9	664
36-60	68,2	118,9	105,7	55,0	13,2	13,2	0
61-90	221,3	80,3	0,0	155,0	21,3	7,3	59
91-180	201,5	209,8	40,0	60,0	34,8	6,5	135
>180	30,3	24,1	0,5	5,0	8,6	10,3	15
Total	2463,4	2626,2	1272,6	1221,5	198,6	86,9	1155

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	5.94%	6.02%	4.87%	5.52%
15-35	5.94%	5.31%	4.87%	5.47%
36-60	—	6.34%	6.04%	6.19%
61-90	6.17%	5.69%	5.64%	5.84%
91-180	6.09%	6.24%	5.94%	6.12%
>180	5.85%	5.77%	5.38%	5.69%
Total	5.97%	5.54%	4.98%	5.55%

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	22	67	3152	3300	37	122	7311	8092	63	134	5328	5951
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2161	2057	0	0	3900	2956	0	0	3299	2380
Otros ^c	67	22	223	176	122	37	536	697	134	63	426	696
Total	89	89	5536	5533	159	159	11747	11745	197	197	9053	9027

^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.