

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de marzo de 2024
Fecha de Información: 01 de marzo 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\$2335 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.24%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	274,3	279,2	92,0	96,6	23,2	13,6	164
15-35	704,0	1170,0	665,7	209,0	22,3	13,0	482
36-60	44,8	9,3	0,0	15,8	9,3	28,9	0
61-90	87,2	59,4	0,0	40,0	14,4	2,2	45
91-180	105,1	110,6	33,4	23,0	37,2	42,1	40
>180	110,2	190,4	105,0	24,3	7,4	7,9	78
Total	1325,5	1818,9	896,1	408,7	113,8	107,8	809

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	6.30%	6.30%	5.94%	6.21%
15-35	6.37%	6.30%	6.09%	6.31%
36-60	—	6.47%	6.17%	6.24%
61-90	6.43%	6.31%	5.18%	5.97%
91-180	6.29%	6.67%	6.06%	6.35%
>180	5.81%	6.21%	5.29%	5.88%
Total	6.30%	6.32%	5.93%	6.24%

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	7	47	1250	1206	41	123	7645	8302	65	134	5402	6091
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	822	867	0	0	3961	3150	0	0	3382	2403
Otros ^c	47	7	35	32	123	41	547	697	134	65	438	702
Total	54	54	2107	2105	164	164	12153	12149	199	199	9222	9196

^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.