

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2024
Fecha de Información: 22 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\$2130 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.08%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	375,4	330,5	139,9	210,0	77,2	51,9	113,5
15-35	590,3	698,0	358,6	206,3	34,3	78,8	305,2
36-60	21,7	6,7	0,0	0,0	6,7	21,7	0,0
61-90	41,3	144,3	92,8	0,0	31,6	21,3	20,0
91-180	166,6	99,3	20,3	52,7	33,7	68,7	45,2
>180	95,2	98,5	34,9	40,5	9,6	0,7	54,0
Total	1290,5	1377,4	646,5	509,5	193,0	243,1	537,9

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	6.22%	6.35%	4.42%	5.71%
15-35	6.28%	6.33%	6.00%	6.23%
36-60	—	6.48%	6.20%	6.27%
61-90	6.29%	6.33%	6.16%	6.30%
91-180	6.19%	6.29%	6.05%	6.15%
>180	5.62%	5.89%	6.00%	5.76%
Total	6.20%	6.32%	5.63%	6.08%

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	18 – 22 mar.				25 - 29 mar.				01 - 05 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	6	89	3895	4177	35	212	2546	2815	123	141	7185	8367
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2291	1986	0	0	1188	1107	0	0	4406	3295
Otros ^c	89	6	257	279	212	35	549	361	141	123	793	713
Total	95	95	6443	6442	247	247	4283	4283	264	264	12384	12375

^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.