

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de abril de 2024
Fecha de Información: 27 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\$2219 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.98%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	360,5	185,7	159,0	341,7	24,7	16,7	2
15-35	665,5	605,9	337,3	501,7	147,7	42,7	121
36-60	4,9	21,0	0,0	0,0	21,0	4,9	0
61-90	57,6	34,7	0,0	39,4	34,7	18,3	0
91-180	19,0	128,6	41,7	0,0	82,0	14,0	5
>180	101,1	177,4	96,9	86,0	65,5	0,1	15
Total	1208,6	1153,4	634,8	968,9	375,6	96,7	143

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	6.06%	5.98%	5.90%	5.93%
15-35	6.13%	6.21%	5.70%	6.00%
36-60	–	6.21%	5.73%	6.12%
61-90	–	6.30%	5.56%	6.05%
91-180	6.06%	6.15%	5.89%	6.11%
>180	5.71%	5.77%	5.50%	5.76%
Total	6.08%	6.11%	5.78%	5.98%

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	25 – 29 mar.				01 - 05 abr.				08 - 12 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	22	151	1279	1157	127	167	8132	8746	69	126	5110	5683
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	408	511	0	0	4566	4011	0	0	3108	2283
Otros ^c	151	22	229	248	167	127	800	731	126	69	394	643
Total	173	173	1916	1916	294	294	13498	13488	195	195	8612	8609

^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.