

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de abril de 2024
Fecha de Información: 02 de abril 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\$2679 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	613,6	442,7	129,5	402,9	110,2	7,7	203,0
15-35	924,0	823,2	385,2	475,7	33,1	43,3	405,0
36-60	68,3	107,0	6,9	0,0	34,3	2,6	65,7
61-90	2,2	19,3	0,0	0,0	19,3	2,2	0,0
91-180	72,7	176,5	65,6	0,0	85,8	47,6	25,1
>180	91,4	66,5	26,0	8,6	10,5	52,8	30,0
Total	1772,2	1635,2	613,2	887,2	293,2	156,2	728,8

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	6.18%		6.20%	5.97%	6.11%
15-35	6.20%		5.55%	5.56%	5.81%
36-60	6.28%		6.46%	6.19%	6.34%
61-90	-		6.63%	6.23%	6.59%
91-180	6.27%		6.23%	6.15%	6.21%
>180	5.87%		5.95%	5.91%	5.91%
Total	6.19%		5.98%	5.76%	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	01 – 05 abr.				08 - 12 abr.				15 - 19 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	116	145	7757	7954	75	133	5389	6074	172	125	5463	5793
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4134	3944	0	0	3163	2319	0	0	3068	2055
Otros ^c	145	116	720	704	133	75	494	650	125	172	354	1036
Total	261	261	12611	12602	208	208	9046	9043	297	297	8885	8884

^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.