

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de abril de 2024
Fecha de Información: 03 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\$3172 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.78%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	485,5	469,5	213,6	337,8	131,8	23,6	124,2
15-35	1115,9	878,4	339,8	588,0	39,6	28,9	499,0
36-60	149,6	143,6	0,0	24,4	28,6	10,2	115,0
61-90	43,6	71,1	38,3	15,0	32,8	28,6	0,0
91-180	120,4	115,9	0,8	0,0	115,1	120,4	0,0
>180	149,1	207,7	123,4	94,9	44,3	14,2	40,0
Total	2064,2	1886,3	715,9	1060,1	392,3	226,0	778,1

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	6.13%		3.58%	6.16%	5.44%
15-35	6.11%		5.60%	5.43%	5.75%
36-60	6.27%		6.63%	5.95%	6.31%
61-90	-		6.52%	6.21%	6.38%
91-180	-		6.18%	5.89%	6.03%
>180	5.98%		5.83%	5.57%	5.84%
Total	6.13%		5.48%	5.75%	5.78%

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	109	131	5820	5830	83	143	5622	6340	173	126	5564	5938
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3241	3199	0	0	3253	2428	0	0	3107	2104
Otros ^c	131	109	383	405	143	83	554	658	126	173	416	1043
Total	240	240	9444	9434	226	226	9429	9426	299	299	9087	9085

^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.