

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de abril de 2024
Fecha de Información: 04 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\$2945 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 | 827,9 | 548,4 | 145,6 | 464,8 | 54,6 | 14,8 | 348,2 |
| 15-35 | 721,0 | 942,6 | 477,9 | 249,7 | 38,0 | 44,6 | 426,8 |
| 36-60 | 24,7 | 48,7 | 4,0 | 0,0 | 44,6 | 24,5 | 0,2 |
| 61-90 | 109,9 | 156,1 | 100,0 | 0,6 | 31,1 | 84,3 | 25,0 |
| 91-180 | 74,4 | 157,1 | 75,0 | 0,0 | 82,1 | 74,4 | 0,0 |
| >180 | 31,3 | 112,7 | 70,0 | 20,0 | 32,7 | 1,3 | 10,0 |
| Total | 1789,2 | 1965,7 | 872,5 | 735,1 | 283,1 | 244,0 | 810,1 |

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 | 6.31% | | 5.36% | 5.75% | 5.90% |
| 15-35 | 6.24% | | 6.29% | 5.91% | 6.19% |
| 36-60 | 5.95% | | 6.50% | 6.16% | 6.38% |
| 61-90 | 6.27% | | 6.11% | 6.13% | 6.14% |
| 91-180 | - | | 6.30% | 6.09% | 6.20% |
| >180 | 6.00% | | 6.04% | 5.44% | 5.95% |
| Total | 6.27% | | 6.10% | 5.87% | 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

| Sector | 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 | 93 | 88 | 4069 | 4087 | 84 | 149 | 5967 | 6634 | 175 | 130 | 5817 | 6070 |
| Intragruppo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2314 | 2158 | 0 | 0 | 3338 | 2594 | 0 | 0 | 3147 | 2261 |
| Otros ^c | 88 | 93 | 88 | 216 | 149 | 84 | 594 | 661 | 130 | 175 | 422 | 1052 |
| Total | 181 | 181 | 6471 | 6461 | 233 | 233 | 9899 | 9889 | 305 | 305 | 9386 | 9383 |

^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.