

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de abril de 2024
Fecha de Información: 05 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\$4280 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.40%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	853,9	618,1	192,9	516,9	115,1	26,9	310,1
15-35	674,3	782,8	325,0	257,0	61,8	21,3	396,0
36-60	358,7	66,3	45,0	351,6	21,3	7,1	0,0
61-90	264,0	482,8	343,0	136,0	14,8	3,0	125,0
91-180	223,6	567,1	433,3	30,0	43,8	103,6	90,0
>180	12,9	302,7	281,6	5,5	15,1	1,4	6,0
Total	2387,4	2820,0	1620,8	1297,0	272,0	163,2	927,1

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	6.58%		6.50%	6.12%	6.44%
15-35	6.61%		6.55%	5.75%	6.41%
36-60	-		6.84%	6.30%	6.70%
61-90	6.62%		5.56%	6.58%	6.41%
91-180	6.49%		6.12%	6.32%	6.32%
>180	5.88%		5.55%	5.42%	5.59%
Total	6.58%		6.39%	6.06%	6.40%

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	12	44	867	813	97	160	6790	7246	179	132	6090	6322
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	383	368	0	0	3487	3048	0	0	3177	2316
Otros ^c	44	12	38	103	160	97	695	669	132	179	427	1053
Total	56	56	1288	1284	257	257	10972	10963	311	311	9694	9691

^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.