

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2024
Fecha de Información: 08 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\$4367 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.52%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupa y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1164,9	1194,4	314,7	435,7	217,7	67,1	662,0
15-35	756,0	721,1	194,0	295,0	116,1	50,0	411,0
36-60	453,8	460,0	96,0	95,0	59,0	53,8	305,0
61-90	360,7	309,1	150,0	150,0	9,1	60,7	150,0
91-180	292,7	125,1	51,4	0,0	35,2	254,2	38,5
>180	8,9	92,2	70,0	0,0	17,2	3,9	5,0
Total	3037,0	2901,9	876,1	975,7	454,3	489,8	1571,5

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	6.71%	6.68%	6.41%	6.62%
15-35	6.64%	6.14%	6.15%	6.38%
36-60	6.59%	7.07%	6.62%	6.71%
61-90	6.54%	6.56%	6.27%	6.50%
91-180	6.41%	6.55%	6.32%	6.36%
>180	5.70%	5.72%	5.40%	5.71%
Total	6.64%	6.51%	6.34%	6.52%

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	08 – 12 abr.				15 - 19 abr.				22 - 26 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	99	163	7288	7843	187	135	6672	6725	180	218	5072	6255
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3872	3275	0	0	3177	2644	0	0	3380	1969
Otros ^c	163	99	697	729	135	187	636	1114	218	180	609	826
Total	262	262	11857	11847	322	322	10485	10483	398	398	9061	9050

^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.