

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2024
Fecha de Información: 09 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\$4518 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.20%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragruppo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	954,4	1021,2	524,2	631,7	185,8	11,5	311,2
15-35	901,6	1008,9	629,7	566,1	57,7	14,0	321,5
36-60	106,6	179,3	40,0	40,5	102,7	29,6	36,5
61-90	20,8	12,5	0,0	0,0	12,5	20,8	0,0
91-180	419,8	197,1	123,3	135,0	33,8	244,8	40,0
>180	230,0	290,1	165,0	113,0	10,1	2,0	115,0
Total	2633,1	2709,0	1482,2	1486,3	402,6	322,5	824,2

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	6.52%	5.79%	6.48%	6.21%
15-35	6.48%	6.41%	6.26%	6.39%
36-60	6.53%	6.55%	3.78%	5.71%
61-90	–	7.13%	6.34%	6.64%
91-180	6.23%	6.31%	5.98%	6.05%
>180	5.57%	5.83%	5.23%	5.68%
Total	6.36%	6.13%	6.16%	6.20%

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	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	77	136	6855	7608	189	136	7028	7008	181	221	5513	6614
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3776	3104	0	0	3255	2958	0	0	3496	2185
Otros ^c	136	77	661	571	136	189	802	1115	221	181	632	831
Total	213	213	11292	11283	325	325	11085	11081	402	402	9641	9630

^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.