

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2024
Fecha de Información: 10 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\$3388 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.07%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	295,8	319,6	162,5	235,7	120,1	23,1	37,0
15-35	681,0	1079,2	709,5	303,2	28,7	36,8	341,1
36-60	504,8	164,0	13,4	250,0	10,6	114,8	140,0
61-90	130,2	141,4	50,0	50,0	41,4	30,2	50,0
91-180	82,3	553,6	460,0	0,0	13,3	2,1	80,2
>180	23,1	71,0	50,0	10,0	11,0	3,1	10,0
Total	1717,1	2328,8	1445,3	848,9	225,2	210,0	658,3

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	6.69%	6.59%	3.48%	5.12%
15-35	6.51%	6.19%	6.47%	6.36%
36-60	6.54%	7.16%	5.95%	6.16%
61-90	6.46%	6.45%	6.36%	6.44%
91-180	6.28%	5.99%	5.88%	6.04%
>180	5.49%	5.70%	5.35%	5.65%
Total	6.48%	6.19%	5.54%	6.07%

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	71	122	5651	6131	191	136	7131	7222	182	223	5571	6750
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2922	2488	0	0	3410	3004	0	0	3507	2230
Otros ^c	122	71	625	570	136	191	807	1119	223	182	751	838
Total	193	193	9198	9189	327	327	11348	11345	405	405	9829	9818

^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.