

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de abril de 2024
Fecha de Información: 11 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\$3689 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.21%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	1128,5	793,1	297,5	587,4	158,3	203,8	337,3
15-35	454,7	1377,3	928,0	90,0	112,3	27,7	337,0
36-60	271,2	176,4	0,0	10,0	5,1	89,9	171,3
61-90	140,2	48,1	10,0	100,0	3,1	5,2	35,0
91-180	74,3	102,2	34,0	0,0	13,2	19,3	55,0
>180	49,8	54,3	0,0	0,8	9,3	4,0	45,0
Total	2118,6	2551,4	1269,5	788,2	301,3	349,9	980,6

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	6.68%	6.66%	4.86%	5.82%
15-35	6.57%	6.62%	6.43%	6.59%
36-60	6.64%	7.12%	6.58%	6.63%
61-90	6.55%	6.46%	6.24%	6.50%
91-180	6.27%	6.27%	6.15%	6.25%
>180	5.89%	6.13%	5.53%	5.90%
Total	6.57%	6.62%	5.24%	6.21%

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	58	80	3802	3976	273	134	7396	7529	184	223	5893	7164
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1877	1764	0	0	3543	3169	0	0	3644	2344
Otros ^c	80	58	340	276	134	273	885	1123	223	184	832	849
Total	138	138	6019	6016	407	407	11824	11821	407	407	10369	10357

^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.