

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2024
Fecha de Información: 17 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\$3898 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.89%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	345,3	145,3	48,2	236,9	17,5	28,9	79,5
15-35	893,1	1411,7	553,8	333,6	325,4	27,0	532,5
36-60	233,7	215,1	0,0	0,0	15,1	33,7	200,0
61-90	696,1	272,3	95,0	205,0	7,2	321,0	170,1
91-180	117,6	346,2	215,0	0,0	16,2	2,6	115,0
>180	198,6	235,8	120,0	80,0	0,6	3,4	115,2
Total	2484,4	2626,4	1032,0	855,5	382,1	416,6	1212,3

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.49%	7.51%	7.49%	7.49%
15-35	7.46%	7.36%	7.05%	7.34%
36-60	7.51%	8.43%	6.99%	7.50%
61-90	6.97%	7.18%	5.88%	6.28%
91-180	6.70%	5.37%	5.98%	5.83%
>180	5.98%	6.24%	5.48%	6.05%
Total	7.19%	6.89%	6.51%	6.89%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

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.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	15 – 19 abr.				22 - 26 abr.				29 abr. - 03 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	80	89	5594	6115	197	226	6860	8033	94	243	6488	7468
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3085	2445	0	0	3897	2751	0	0	3697	2711
Otros ^c	89	80	663	780	226	197	946	909	243	94	846	845
Total	169	169	9342	9340	423	423	11703	11693	337	337	11031	11024

^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.