

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2024
Fecha de Información: 18 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\$3793 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.31%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	506,5	570,5	110,3	364,2	342,2	24,2	118,0
15-35	615,6	914,0	566,2	331,0	109,2	46,1	238,5
36-60	49,8	22,6	0,0	0,0	2,1	29,3	20,5
61-90	489,9	213,5	110,0	255,0	18,5	149,9	85,0
91-180	454,5	247,5	155,0	12,8	12,5	361,6	80,0
>180	20,3	245,4	230,0	0,0	0,4	5,3	15,0
Total	2136,6	2213,4	1171,5	963,1	484,8	616,5	557,0

^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	7.33%	2.92%	6.69%	4.58%
15-35	7.30%	7.37%	7.10%	7.28%
36-60	6.97%	7.29%	6.84%	6.91%
61-90	6.95%	6.79%	6.75%	6.80%
91-180	6.69%	6.57%	6.14%	6.33%
>180	6.30%	6.73%	5.40%	6.08%
Total	7.12%	5.68%	6.64%	6.31%

^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	53	67	4049	4299	201	226	7021	8516	98	244	6587	7554
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2215	1881	0	0	3980	2828	0	0	3725	2761
Otros ^c	67	53	186	270	226	201	1275	919	244	98	858	850
Total	120	120	6450	6450	427	427	12276	12263	342	342	11170	11165

^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.