

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2024
Fecha de Información: 26 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\$3221 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.43%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	697,3	407,7	351,4	515,8	28,2	153,6	28,0
15-35	313,7	674,6	312,6	136,9	215,1	29,7	147,0
36-60	43,6	188,5	175,2	0,0	13,2	43,6	0,0
61-90	80,1	93,9	12,9	0,0	30,9	29,9	50,2
91-180	198,1	237,3	183,0	175,3	34,1	2,7	20,2
>180	240,9	335,2	285,5	188,1	5,2	8,3	44,5
Total	1573,7	1937,2	1320,5	1016,1	326,7	267,7	289,9

^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	6.25%	6.43%	3.09%	4.07%
15-35	6.24%	6.07%	6.16%	6.12%
36-60	–	6.59%	5.98%	6.12%
61-90	6.07%	6.15%	5.94%	6.06%
91-180	6.01%	6.11%	5.78%	6.06%
>180	5.74%	5.76%	5.65%	5.73%
Total	6.12%	6.13%	4.18%	5.43%

^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	22 – 26 abr.				29 abr. - 03 may.				06 - 10 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	101	46	1763	2009	118	251	8272	9510	230	136	7589	8546
Intragrupo y off-shore ^b	0	9	1050	942	0	0	4924	3777	0	0	4193	3096
Otros ^c	46	92	311	173	251	118	1164	1067	136	230	912	1004
Total	147	147	3124	3124	369	369	14360	14354	366	366	12694	12646

^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.