

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2024
Fecha de Información: 15 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\$4339 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.82%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupa y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	317,3	745,9	464,9	138,6	137,0	34,7	144
15-35	1130,7	1208,0	629,7	563,6	53,3	42,1	525
36-60	514,3	176,9	65,0	240,1	6,9	169,3	105
61-90	55,2	3,5	0,0	0,0	3,5	55,2	0
91-180	271,4	396,2	241,4	14,0	14,8	117,4	140
>180	255,0	308,8	168,8	108,1	10,0	16,9	130
Total	2543,9	2839,3	1569,8	1064,4	225,5	435,5	1044

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	7.42%		7.35%	7.23%	7.34%
15-35	7.42%		5.94%	7.25%	6.72%
36-60	7.06%		7.30%	7.01%	7.04%
61-90	-		6.81%	6.90%	6.89%
91-180	6.69%		6.49%	6.50%	6.59%
>180	5.73%		6.08%	5.75%	5.77%
Total	7.08%		6.47%	6.94%	6.82%

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	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	283	140	7665	8063	192	225	6449	7617	91	242	6183	6907
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3997	3376	0	0	3782	2638	0	0	3552	2620
Otros ^c	140	283	929	1150	225	192	924	888	241	91	628	830
Total	423	423	12591	12589	417	417	11155	11143	332	333	10363	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.