

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2024
Fecha de Información: 16 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\$4828 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.15%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	707,1	739,8	255,9	330,2	127,1	20,1	356,7
15-35	1221,6	1737,2	804,5	347,9	232,7	173,6	700,0
36-60	602,4	267,9	140,0	125,7	22,3	371,2	105,6
61-90	71,9	57,6	0,2	0,0	40,2	54,7	17,2
91-180	243,5	185,3	42,2	25,0	18,1	93,5	125,0
>180	125,9	177,0	167,9	86,7	4,1	34,1	5,0
Total	2972,2	3164,8	1410,8	915,5	444,5	747,2	1309,5

^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	7.43%	7.01%	6.72%	7.07%
15-35	7.35%	7.39%	7.26%	7.35%
36-60	7.00%	7.04%	7.03%	7.02%
61-90	6.56%	6.99%	7.92%	7.38%
91-180	6.68%	6.53%	6.56%	6.62%
>180	5.69%	5.96%	5.67%	5.80%
Total	7.26%	7.22%	6.97%	7.15%

^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	188	111	7177	7623	194	225	6705	7940	93	242	6383	7322
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3757	3124	0	0	3872	2670	0	0	3601	2658
Otros ^c	111	188	899	1085	225	194	937	892	242	93	840	838
Total	299	299	11833	11832	419	419	11514	11502	335	335	10824	10818

^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.