

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2024
Fecha de Información: 25 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\$3013 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.16%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	412,3	436,0	335,2	336,6	65,8	40,7	35,0
15-35	511,5	863,1	470,1	176,9	93,0	34,6	300,0
36-60	51,8	277,5	251,8	0,0	25,7	51,8	0,0
61-90	360,6	99,8	53,9	189,0	15,7	141,3	30,2
91-180	124,9	168,5	100,0	35,4	23,4	44,3	45,1
>180	104,9	70,5	8,7	26,2	3,7	20,7	58,0
Total	1566,0	1915,3	1219,7	764,1	227,2	333,5	468,4

^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	6.37%	6.28%	6.25%	6.27%
15-35	6.42%	6.46%	5.07%	6.15%
36-60	–	6.35%	6.02%	6.29%
61-90	6.18%	6.76%	6.07%	6.24%
91-180	6.06%	6.03%	5.85%	5.99%
>180	5.83%	6.13%	5.35%	5.72%
Total	6.30%	6.37%	5.75%	6.16%

^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	153	94	3706	4095	113	249	7733	9207	223	137	7504	8487
Intragrupo y off-shore ^b	0	9	2089	1844	0	0	4649	3386	0	0	4160	3032
Otros ^c	94	145	415	260	249	113	1144	927	137	223	907	1003
Total	247	248	6210	6199	362	362	13526	13520	360	360	12571	12522

^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.