

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2024
Fecha de Información: 10 de mayo 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\$2199 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.45%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragruppo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	285,3	148,3	110,1	116,1	28,2	159,2	10,0
15-35	624,1	843,0	490,1	384,0	151,9	39,1	201,0
36-60	57,6	72,6	10,0	0,0	12,6	7,6	50,0
61-90	25,8	14,3	0,0	0,0	14,3	25,8	0,0
91-180	68,4	157,1	65,0	35,0	72,1	13,4	20,0
>180	102,3	121,6	74,2	61,8	6,8	0,0	40,5
Total	1163,4	1356,8	749,5	596,9	285,8	245,1	321,5

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	6.09%		6.12%	-0.89%	1.34%
15-35	6.13%		5.02%	3.99%	4.91%
36-60	6.10%		6.26%	6.02%	6.12%
61-90	-		6.07%	5.89%	5.95%
91-180	5.84%		5.87%	5.84%	5.86%
>180	5.66%		5.65%	-	5.66%
Total	6.05%		5.30%	2.39%	4.45%

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	06 – 10 may.				13 - 17 may.				20 - 24 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	32	50	1708	1831	100	143	6945	7912	53	243	7285	8732
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1119	960	0	0	4506	3240	0	1	5100	3107
Otros ^c	50	32	56	89	143	100	976	1253	243	52	688	1188
Total	82	82	2883	2880	243	243	12427	12405	296	296	13073	13027

^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.