

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2024
Fecha de Información: 17 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\$3468 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.48%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 | 374,2 | 636,5 | 258,1 | 330,6 | 368,4 | 33,6 | 10,0 |
| 15-35 | 610,7 | 875,8 | 562,0 | 249,5 | 34,1 | 81,6 | 279,7 |
| 36-60 | 100,7 | 74,1 | 0,0 | 0,0 | 10,1 | 36,7 | 64,0 |
| 61-90 | 299,3 | 113,0 | 0,0 | 18,0 | 53,0 | 221,3 | 60,0 |
| 91-180 | 288,0 | 240,9 | 70,0 | 86,0 | 50,9 | 82,1 | 120,0 |
| >180 | 241,9 | 296,7 | 70,9 | 89,8 | 75,8 | 2,1 | 150,0 |
| Total | 1914,8 | 2237,0 | 961,0 | 773,8 | 592,3 | 457,4 | 683,7 |

^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 | 6.34% | 3.67% | 5.02% | 4.05% |
| 15-35 | 6.31% | 6.33% | 5.98% | 6.26% |
| 36-60 | 6.26% | 6.36% | 6.01% | 6.19% |
| 61-90 | 6.06% | 6.18% | 5.50% | 5.71% |
| 91-180 | 5.64% | 5.69% | 5.64% | 5.66% |
| >180 | 5.39% | 5.67% | 5.18% | 5.42% |
| Total | 5.97% | 5.14% | 5.52% | 5.48% |

^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 | 13 - 17 may. | | | | 20 - 24 may. | | | | 27 - 31 may. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 94 | 39 | 778 | 824 | 70 | 255 | 8040 | 9863 | 43 | 407 | 6268 | 7219 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 296 | 234 | 0 | 1 | 5449 | 3689 | 0 | 0 | 3876 | 2374 |
| Otros ^c | 39 | 94 | 66 | 81 | 255 | 69 | 1335 | 1226 | 407 | 43 | 753 | 1288 |
| Total | 133 | 133 | 1140 | 1139 | 325 | 325 | 14824 | 14778 | 450 | 450 | 10897 | 10881 |

^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.