

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2024
Fecha de Información: 20 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\$3472 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.19%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	680,2	563,0	300,5	416,0	19,5	21,2	243,0
15-35	692,9	1217,0	674,4	278,5	156,6	28,4	386,0
36-60	170,2	59,7	0,0	59,3	14,6	65,7	45,1
61-90	4,5	98,0	51,7	0,0	46,3	4,5	0,0
91-180	240,7	111,6	72,2	240,0	39,4	0,7	0,0
>180	202,4	144,8	95,8	163,4	10,0	0,0	39,0
Total	1990,9	2194,1	1194,7	1157,3	286,2	120,4	713,1

^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	6.41%	6.80%	6.07%	6.33%
15-35	6.40%	6.11%	6.19%	6.22%
36-60	6.42%	6.37%	5.99%	6.19%
61-90	–	5.96%	4.19%	5.81%
91-180	–	5.71%	5.69%	5.71%
>180	5.50%	5.61%	5.44%	5.49%
Total	6.36%	6.21%	6.00%	6.19%

^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

Sector	20 - 24 may.				27 - 31 may.				03 - 07 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	74	258	8699	10318	47	410	6471	7394	93	135	6509	7122
Intragruppo y off-shore ^b	0	1	5674	4083	0	0	3987	2512	0	0	4249	2748
Otros ^c	258	73	1341	1267	410	47	763	1299	135	93	470	1357
Total	332	332	15714	15668	457	457	11221	11205	228	228	11228	11227

^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.