

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2024
Fecha de Información: 21 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\$4555 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.03%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	1138,2	816,4	609,8	1040,2	128,1	19,6	78,5
15-35	691,9	1261,4	983,7	407,4	26,2	32,9	251,6
36-60	243,7	215,4	0,0	30,6	15,1	12,7	200,4
61-90	6,6	47,9	0,0	0,0	47,9	6,6	0,0
91-180	326,4	111,2	34,3	144,8	21,9	126,6	55,0
>180	186,5	190,2	80,2	77,4	15,0	14,1	95,0
Total	2593,2	2642,5	1708,0	1700,4	254,2	212,4	680,4

^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	6.41%	6.22%	5.79%	5.97%
15-35	6.39%	6.17%	5.99%	6.17%
36-60	6.29%	6.56%	6.17%	6.30%
61-90	–	6.20%	5.82%	6.15%
91-180	5.85%	5.87%	5.75%	5.80%
>180	5.57%	5.60%	5.36%	5.52%
Total	6.20%	6.17%	5.81%	6.03%

^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	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	65	232	7604	8550	52	412	6805	7872	94	138	6803	7442
Intragrupo y off-shore ^b	0	1	4793	3902	0	0	4346	2841	0	0	4398	2874
Otros ^c	232	64	1281	1189	412	52	882	1304	138	94	475	1359
Total	297	297	13678	13641	464	464	12033	12017	232	232	11676	11675

^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.