

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2024
Fecha de Información: 22 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\$3797 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.19%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	992,2	567,5	112,4	720,5	251,1	67,7	204
15-35	523,7	1331,7	996,8	160,9	22,8	50,8	312
36-60	37,0	95,0	65,0	0,0	15,0	22,0	15
61-90	80,5	41,5	0,4	39,8	16,1	15,7	25
91-180	284,0	156,9	80,0	77,9	76,9	206,1	0
>180	79,2	173,4	72,8	17,5	90,6	51,6	10
Total	1996,6	2366,1	1327,5	1016,7	472,6	414,0	566

^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	6.71%	6.66%	5.41%	6.06%
15-35	6.66%	6.47%	6.54%	6.53%
36-60	6.59%	6.26%	6.21%	6.30%
61-90	6.20%	6.43%	5.89%	6.18%
91-180	–	5.88%	5.76%	5.81%
>180	5.66%	5.46%	5.57%	5.51%
Total	6.64%	6.37%	5.72%	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

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	57	209	6545	7291	54	414	7147	8238	96	139	6874	7483
Intragrupo y off-shore ^b	0	1	4054	3465	0	0	4379	3052	0	0	4436	2923
Otros ^c	209	56	1206	1026	414	54	1129	1350	139	96	476	1378
Total	266	266	11805	11782	468	468	12655	12640	235	235	11786	11784

^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.