

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2024
Fecha de Información: 23 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\$2741 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.37%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	718,2	351,2	132,4	558,0	102,8	44,2	116,0
15-35	490,3	1078,0	715,8	132,0	31,2	27,3	331,1
36-60	59,5	28,0	20,0	10,0	8,0	49,5	0,0
61-90	30,8	234,2	125,6	0,0	83,2	5,4	25,4
91-180	146,3	68,1	8,7	35,4	24,4	75,9	35,0
>180	12,8	30,7	23,4	2,9	7,3	9,9	0,0
Total	1457,8	1790,2	1025,9	738,2	256,8	212,2	507,5

^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	6.91%		6.82%	5.80%	6.21%
15-35	6.53%		6.64%	6.11%	6.55%
36-60	-		6.46%	6.57%	6.53%
61-90	6.32%		6.31%	5.63%	6.29%
91-180	5.99%		5.93%	5.88%	5.91%
>180	-		5.46%	5.24%	5.34%
Total	6.57%		6.59%	5.91%	6.37%

^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	50	190	4649	5030	56	415	7326	8392	97	139	6947	7601
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2933	2699	0	0	4440	3189	0	0	4501	2956
Otros ^c	190	50	640	470	415	56	1217	1387	139	97	493	1382
Total	240	240	8222	8199	471	471	12983	12968	236	236	11941	11939

^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.