

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2024
Fecha de Información: 27 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\$277 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.40%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	117,7	116,8	9,0	11,6	7,8	6,1	100
15-35	49,7	77,7	50,0	16,9	1,7	6,8	26
36-60	5,8	10,3	7,5	0,0	2,8	5,8	0
61-90	0,7	1,6	0,3	0,0	1,3	0,7	0
91-180	6,0	1,6	0,0	5,6	1,6	0,4	0
>180	4,8	10,3	4,7	4,7	5,6	0,1	0
Total	184,7	218,2	71,5	38,8	20,6	19,8	126

^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	6.00%	7.02%	6.98%	6.12%
15-35	6.94%	6.71%	6.63%	6.75%
36-60	–	7.14%	6.34%	6.60%
61-90	–	6.42%	6.32%	6.38%
91-180	–	5.62%	5.99%	5.69%
>180	–	5.63%	5.54%	5.63%
Total	6.19%	6.64%	6.63%	6.40%

^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	27 – 31 may.				03 - 07 jun.				10 - 14 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	64	419	7540	8697	101	139	7213	8055	30	148	6327	7260
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	4634	3365	0	0	4525	2984	0	0	4459	2693
Otros ^c	419	64	1309	1406	139	101	695	1391	148	30	461	1287
Total	483	483	13483	13468	240	240	12433	12430	178	178	11247	11240

^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.