

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2024
Fecha de Información: 28 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\$3806 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.34%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	1158,6	741,4	453,7	830,4	115,0	155,7	172,6
15-35	717,8	851,6	434,5	387,2	168,5	82,0	248,6
36-60	122,7	69,5	0,0	45,0	19,1	27,4	50,4
61-90	106,5	34,0	0,4	0,0	33,6	106,5	0,0
91-180	96,9	121,0	18,5	6,0	37,5	25,9	65,0
>180	116,4	257,1	176,2	62,9	30,5	3,0	50,5
Total	2318,9	2074,6	1083,4	1331,5	404,2	400,3	587,1

^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	6.84%	6.56%	5.66%	6.09%
15-35	6.84%	6.84%	6.66%	6.80%
36-60	6.18%	6.48%	6.52%	6.33%
61-90	–	6.32%	6.13%	6.18%
91-180	5.95%	5.74%	5.98%	5.90%
>180	5.49%	5.65%	5.29%	5.57%
Total	6.57%	6.62%	5.95%	6.34%

^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	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	65	419	8323	9015	108	143	7451	8417	34	148	6646	7307
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4866	3781	0	0	4701	3135	0	0	4482	2997
Otros ^c	419	65	1324	1703	143	108	799	1395	148	34	476	1292
Total	484	484	14513	14499	251	251	12951	12947	182	182	11604	11596

^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.