

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2024
Fecha de Información: 29 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\$4044 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.10%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	736,8	360,7	200,3	606,1	60,4	30,7	100,0
15-35	1048,9	1305,1	874,0	575,5	64,6	106,9	366,5
36-60	39,9	7,0	0,0	0,0	7,0	39,9	0,0
61-90	144,7	400,9	293,2	0,3	12,7	49,4	95,0
91-180	326,5	198,8	40,6	38,6	18,2	147,9	140,0
>180	102,5	169,2	69,5	6,7	4,6	0,8	95,0
Total	2399,2	2441,7	1477,6	1227,1	167,5	375,6	796,5

^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	6.51%	6.36%	5.83%	6.10%
15-35	6.46%	6.54%	6.05%	6.33%
36-60	–	5.61%	6.14%	6.06%
61-90	6.08%	5.62%	6.06%	5.78%
91-180	5.81%	5.88%	5.71%	5.78%
>180	5.50%	5.50%	5.34%	5.50%
Total	6.19%	6.22%	5.94%	6.10%

^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	56	253	7361	7858	112	146	7723	8596	37	149	6686	7438
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4298	3752	0	0	4792	3361	0	0	4608	3025
Otros ^c	253	56	1081	1114	146	112	852	1406	149	37	481	1304
Total	309	309	12740	12724	258	258	13367	13363	186	186	11775	11767

^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.