

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2024
Fecha de Información: 14 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\$3387 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.90%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	494,3	435,0	284,4	346,9	73,1	69,9	77,5
15-35	592,1	585,0	378,0	392,2	62,5	55,4	144,5
36-60	130,3	169,4	35,9	24,2	41,1	13,8	92,4
61-90	2,1	30,5	0,0	0,0	30,5	2,1	0,0
91-180	668,4	801,8	217,0	100,3	46,0	29,2	538,8
>180	293,6	73,3	25,8	254,4	11,5	3,2	36,0
Total	2180,8	2095,1	941,1	1118,0	264,8	173,7	889,2

^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	6.07%	6.18%	5.27%	5.61%
15-35	6.06%	6.16%	6.00%	6.10%
36-60	6.10%	6.32%	6.01%	6.15%
61-90	–	6.26%	5.91%	6.23%
91-180	5.89%	5.97%	5.75%	5.89%
>180	5.63%	5.85%	5.74%	5.72%
Total	5.94%	6.14%	5.60%	5.90%

^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	13 – 17 may.				20 - 24 may.				27 - 31 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	154	144	7352	8186	56	252	7397	8881	39	401	5803	6344
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4731	3558	0	1	5132	3151	0	0	3155	2035
Otros ^c	144	154	980	1298	252	55	746	1195	401	39	702	1266
Total	298	298	13063	13042	308	308	13275	13227	440	440	9660	9645

^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.