

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2024
Fecha de Información: 16 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\$3928 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.76%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	578,7	589,3	244,3	458,2	237,1	12,5	108,0
15-35	993,4	1420,6	660,4	253,0	47,2	27,4	713,0
36-60	10,7	5,9	0,0	0,0	5,9	10,7	0,0
61-90	312,7	250,5	42,6	41,2	9,6	73,1	198,4
91-180	360,0	308,0	147,6	50,0	65,1	214,8	95,2
>180	129,2	125,0	71,3	87,3	12,8	1,0	41,0
Total	2384,7	2699,3	1166,1	889,7	377,6	339,5	1155,6

^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	6.03%	5.87%	5.13%	5.61%
15-35	6.08%	5.67%	5.63%	5.86%
36-60	–	6.14%	5.93%	6.00%
61-90	5.98%	6.12%	5.81%	5.94%
91-180	5.76%	5.77%	5.64%	5.71%
>180	5.27%	5.65%	4.93%	5.21%
Total	6.00%	5.77%	5.45%	5.76%

^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	108	78	3318	3544	60	258	7879	9353	40	405	6094	7130
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1924	1668	0	1	5278	3534	0	0	3814	2213
Otros ^c	78	108	152	172	258	59	995	1218	405	40	726	1275
Total	186	186	5394	5384	318	318	14152	14105	445	445	10634	10618

^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.