

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de mayo de 2024
Fecha de Información: 02 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\$3036 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.87%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1124,3	850,6	191,2	465,9	10,4	9,4	649,0
15-35	558,9	995,9	468,3	194,5	181,6	18,4	346,0
36-60	114,2	191,9	130,4	40,0	21,3	34,0	40,3
61-90	11,0	31,5	25,2	0,0	6,3	11,0	0,0
91-180	105,4	33,4	10,0	65,0	8,4	25,5	15,0
>180	51,8	33,4	16,5	33,7	0,9	2,1	16,0
Total	1965,6	2136,7	841,5	799,1	229,0	100,3	1066,2

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ¹		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	6.09%		6.08%	5.00%	5.73%
15-35	6.08%		5.97%	5.92%	6.00%
36-60	6.12%		6.15%	5.82%	6.08%
61-90	-		6.06%	5.80%	5.90%
91-180	5.91%		5.99%	5.83%	5.86%
>180	5.57%		5.66%	5.70%	5.64%
Total	6.08%		6.01%	5.37%	5.87%

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.

³Cifras en millones de dólares

²Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

³Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

¹Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	29 abr. - 03 may.				06 - 10 may.				13 - 17 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	74	70	5109	5280	238	140	9167	10076	56	138	5908	7134
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2530	2347	0	0	4803	3978	0	0	4075	2545
Otros ^c	70	74	413	420	140	238	1154	1020	138	56	770	1053
Total	144	144	8052	8047	378	378	15124	15074	194	194	10753	10732

^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.