

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de mayo de 2024
Fecha de Información: 07 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\$4268 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.04%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	424,8	419,9	157,0	301,7	146,9	7,1	116,0
15-35	1316,3	1364,6	508,0	480,1	25,6	5,1	831,0
36-60	209,3	172,0	48,8	33,4	4,9	57,5	118,4
61-90	38,0	20,7	15,0	0,0	5,7	38,0	0,0
91-180	422,5	597,1	270,1	4,0	40,7	132,1	286,4
>180	404,8	323,8	218,1	305,8	11,7	4,9	94,0
Total	2815,5	2898,1	1217,0	1125,0	235,4	244,7	1445,7

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	6.42%		6.31%	5.83%	6.18%
15-35	6.41%		6.42%	5.08%	6.12%
36-60	6.32%		6.67%	6.02%	6.23%
61-90	-		6.60%	6.14%	6.20%
91-180	5.94%		5.68%	6.04%	5.85%
>180	5.53%		5.52%	5.45%	5.51%
Total	6.25%		6.13%	5.54%	6.04%

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	06 – 10 may.				13 - 17 may.				20 - 24 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	100	117	7728	8380	61	141	6240	7512	45	241	6809	8309
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4617	3876	0	0	4222	2777	0	1	4958	2892
Otros ^c	117	100	885	926	141	61	914	1066	241	44	643	1162
Total	217	217	13230	13182	202	202	11376	11355	286	286	12410	12363

^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.