

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2024
Fecha de Información: 24 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\$2792 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.36%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	426,5	630,7	208,1	258,6	287,8	33,1	134,8
15-35	457,8	762,0	508,1	200,9	30,2	33,3	223,6
36-60	57,1	20,4	0,0	0,0	20,4	57,1	0,0
61-90	356,2	28,8	0,0	60,2	8,8	276,0	20,0
91-180	69,2	54,9	28,3	50,0	26,5	19,2	0,0
>180	151,7	194,9	150,8	102,3	4,6	9,9	39,5
Total	1518,6	1691,7	895,4	672,0	378,4	428,6	417,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.96%		5.88%	6.50%	6.28%
15-35	6.85%		6.65%	6.77%	6.73%
36-60	—		6.65%	6.35%	6.43%
61-90	6.41%		6.41%	5.94%	5.98%
91-180	—		6.05%	5.65%	5.90%
>180	5.37%		5.57%	5.32%	5.44%
Total	6.72%		6.27%	6.27%	6.36%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{365/\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	20 – 24 may.				27 - 31 may.				03 - 07 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	11	161	1352	1343	59	419	7485	8642	101	139	7110	7948
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	862	882	0	0	4600	3331	0	0	4525	2981
Otros ^c	161	11	60	48	419	59	1309	1405	139	101	688	1391
Total	172	172	2274	2273	478	478	13394	13378	240	240	12323	12320

^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.