

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2024
Fecha de Información: 24 de abril 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\$4544 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.34%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	1175,4	724,5	407,8	847,1	31,6	43,3	285,0
15-35	729,3	1251,1	999,3	513,5	45,8	9,9	206,0
36-60	219,7	258,7	120,0	0,0	39,7	120,7	99,0
61-90	151,6	186,8	135,0	112,8	21,8	8,7	30,0
91-180	153,2	247,8	163,5	10,0	3,8	62,7	80,5
>180	100,1	56,2	34,9	76,0	11,3	14,1	10,0
Total	2529,3	2725,0	1860,5	1559,4	154,0	259,4	710,5

^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	6.29%	4.59%	4.80%	5.06%
15-35	6.31%	5.51%	3.63%	5.24%
36-60	6.30%	6.22%	6.04%	6.18%
61-90	6.12%	5.72%	6.13%	5.93%
91-180	6.01%	5.65%	5.95%	5.80%
>180	5.84%	5.51%	5.43%	5.54%
Total	6.25%	5.42%	4.74%	5.34%

^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	22 – 26 abr.				29 abr. - 03 may.				06 - 10 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	200	143	5935	6487	107	250	7492	8902	220	136	7465	8366
Intragrupo y off-shore ^b	0	9	3029	2739	0	0	4417	3184	0	0	4064	3032
Otros ^c	143	191	981	707	250	107	1085	903	136	220	902	984
Total	343	343	9945	9933	357	357	12994	12989	356	356	12431	12382

^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.