

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de mayo de 2024
Fecha de Información: 03 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\$2928 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.79%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragruppo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	475,3	359,8	224,1	322,6	11,7	28,7	124,0
15-35	883,7	1042,5	433,1	310,9	91,6	55,0	517,8
36-60	16,3	30,9	20,0	0,0	10,9	16,3	0,0
61-90	38,8	89,4	59,6	10,0	9,9	8,8	20,0
91-180	375,8	467,6	89,9	5,0	12,7	5,8	365,0
>180	142,6	131,8	9,9	22,1	21,9	20,5	100,0
Total	1932,3	2122,1	836,6	670,6	158,7	134,9	1126,8

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	6.16%		6.16%	4.00%	5.17%
15-35	6.25%		5.79%	6.16%	6.06%
36-60	-		6.37%	6.07%	6.19%
61-90	6.13%		6.23%	6.07%	6.13%
91-180	5.92%		5.99%	5.79%	5.93%
>180	5.64%		5.44%	5.37%	5.57%
Total	6.08%		5.91%	5.10%	5.79%

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	11	30	644	687	256	141	9507	10382	59	139	6026	7176
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	430	384	0	0	5025	4241	0	0	4097	2638
Otros ^c	30	11	47	48	141	256	1164	1023	139	59	770	1058
Total	41	41	1121	1119	397	397	15696	15646	198	198	10893	10872

^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.