

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2024
Fecha de Información: 08 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\$3187 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.94%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	700,1	429,3	259,4	561,4	70,0	38,9	99,8
15-35	828,2	885,3	568,2	448,7	14,2	76,7	302,8
36-60	12,5	23,3	0,0	1,3	23,3	11,2	0,0
61-90	172,1	70,2	12,2	20,0	2,9	97,1	55,0
91-180	69,0	247,1	195,0	28,3	12,0	0,6	40,1
>180	162,3	185,9	85,1	62,3	0,8	0,0	100,0
Total	1944,2	1841,0	1119,9	1122,0	123,3	224,5	597,7

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	6.26%	4.71%	5.99%	5.74%
15-35	6.28%	6.06%	6.07%	6.13%
36-60	—	6.58%	6.17%	6.44%
61-90	6.19%	6.21%	5.89%	5.99%
91-180	5.96%	5.93%	5.02%	5.93%
>180	5.54%	5.40%	5.06%	5.49%
Total	6.13%	5.72%	6.01%	5.94%

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	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	55	96	6591	6917	79	142	6440	7719	47	241	7126	8535
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3810	3284	0	0	4332	2923	0	1	5055	3088
Otros ^c	96	55	613	797	142	79	967	1075	241	46	661	1172
Total	151	151	11014	10998	221	221	11739	11717	288	288	12842	12795

^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.