

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de mayo de 2024
Fecha de Información: 09 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\$3572 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.85%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	859,6	287,9	116,7	636,1	10,2	62,4	161,0
15-35	893,1	1494,1	919,1	223,6	18,0	112,5	557,0
36-60	57,6	79,2	10,0	0,0	16,2	4,6	53,0
61-90	124,7	90,8	65,0	80,8	15,4	33,5	10,4
91-180	63,3	164,1	23,2	10,0	110,9	23,3	30,0
>180	136,4	230,8	104,3	32,9	28,4	5,6	98,0
Total	2134,6	2346,9	1238,3	983,3	199,2	241,9	909,4

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	6.15%		6.10%	5.91%	5.98%
15-35	6.12%		5.41%	6.05%	5.77%
36-60	6.08%		6.42%	5.60%	6.13%
61-90	6.06%		6.12%	5.98%	6.06%
91-180	5.95%		5.97%	5.89%	5.95%
>180	5.63%		5.73%	5.20%	5.64%
Total	6.06%		5.60%	5.94%	5.85%

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	42	70	4267	4621	81	142	6712	7807	50	242	7275	8705
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2910	2391	0	0	4418	3145	0	1	5093	3107
Otros ^c	70	42	97	246	142	81	969	1126	242	49	668	1178
Total	112	112	7274	7258	223	223	12099	12078	292	292	13036	12990

^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.