

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2024
Fecha de Información: 15 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\$3328 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.78%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragruppo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 867,5 | 242,3 | 132,6 | 769,9 | 32,7 | 20,6 | 77 |
| 15-35 | 436,7 | 924,3 | 792,5 | 283,0 | 44,8 | 66,7 | 87 |
| 36-60 | 17,6 | 31,8 | 0,0 | 10,0 | 31,8 | 7,6 | 0 |
| 61-90 | 75,3 | 131,8 | 10,1 | 40,4 | 101,7 | 14,9 | 20 |
| 91-180 | 272,0 | 206,3 | 31,5 | 140,0 | 69,8 | 27,0 | 105 |
| >180 | 176,4 | 289,9 | 206,1 | 116,5 | 28,8 | 5,0 | 55 |
| Total | 1845,5 | 1826,5 | 1172,8 | 1359,7 | 309,8 | 141,8 | 344 |

^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 | 5.93% | 5.91% | 5.52% | 5.67% |
| 15-35 | 5.88% | 5.93% | 5.81% | 5.87% |
| 36-60 | – | 6.29% | 2.58% | 5.58% |
| 61-90 | 5.93% | 6.14% | 5.74% | 6.07% |
| 91-180 | 5.78% | 5.86% | 5.57% | 5.79% |
| >180 | 5.32% | 5.86% | 5.28% | 5.50% |
| Total | 5.77% | 5.96% | 5.59% | 5.78% |

^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 | 13 - 17 may. | | | | 20 - 24 may. | | | | 27 - 31 may. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 134 | 125 | 5752 | 5906 | 58 | 257 | 7549 | 8977 | 40 | 405 | 6018 | 6969 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3240 | 2845 | 0 | 1 | 5183 | 3269 | 0 | 0 | 3692 | 2165 |
| Otros ^c | 125 | 134 | 694 | 924 | 257 | 57 | 771 | 1210 | 405 | 40 | 713 | 1273 |
| Total | 259 | 259 | 9686 | 9675 | 315 | 315 | 13503 | 13456 | 445 | 445 | 10423 | 10407 |

^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.