

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de junio de 2024
Fecha de Información: 30 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\$3473 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.32%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	1136,7	434,1	215,6	960,3	62,0	19,9	156,5
15-35	431,1	1323,9	978,9	75,7	53,5	64,0	291,5
36-60	68,1	11,1	0,0	0,0	11,1	68,1	0,0
61-90	88,2	82,1	22,4	31,2	19,3	16,7	40,4
91-180	61,3	114,1	42,3	0,0	41,5	31,0	30,3
>180	180,9	120,4	56,5	68,6	3,6	52,1	60,3
Total	1966,3	2085,8	1315,7	1135,7	191,1	251,6	579,0

^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	6.31%	6.24%	6.63%	6.48%
15-35	6.30%	6.50%	6.23%	6.43%
36-60	–	6.40%	6.17%	6.20%
61-90	5.98%	5.96%	5.99%	5.97%
91-180	5.79%	5.81%	5.72%	5.78%
>180	5.52%	5.59%	5.31%	5.39%
Total	6.17%	6.39%	6.34%	6.32%

^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	27 – 31 may.				03 - 07 jun.				10 - 14 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	49	214	5624	5536	115	146	8458	8817	39	149	6717	7671
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3064	2994	0	0	4902	3982	0	0	4770	3032
Otros ^c	214	49	570	713	146	115	863	1419	149	39	532	1308
Total	263	263	9258	9243	261	261	14223	14218	188	188	12019	12011

^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.