

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de junio de 2024
Fecha de Información: 31 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\$2465 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.22%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	588,8	507,1	227,1	416,6	130,0	22,1	150,0
15-35	627,6	788,2	362,4	210,9	47,3	38,2	378,5
36-60	23,0	27,5	0,0	0,0	27,5	23,0	0,0
61-90	23,9	87,7	5,3	0,0	62,2	3,7	20,2
91-180	169,2	96,5	11,7	53,2	34,8	66,0	50,0
>180	44,3	99,3	75,4	24,3	4,5	0,5	19,4
Total	1476,8	1606,4	681,9	705,1	306,3	153,5	618,2

^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	6.75%	6.38%	6.28%	6.45%
15-35	6.28%	6.35%	6.17%	6.28%
36-60	–	6.26%	5.94%	6.12%
61-90	6.03%	6.05%	5.40%	6.02%
91-180	5.68%	5.89%	5.67%	5.73%
>180	5.32%	5.43%	5.10%	5.23%
Total	6.31%	6.28%	6.02%	6.22%

^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	30	20	1888	1806	119	153	9026	9173	45	150	6731	7817
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	844	894	0	0	5093	4403	0	0	4806	3032
Otros ^c	20	30	225	242	153	119	887	1427	150	45	632	1312
Total	50	50	2957	2942	272	272	15006	15003	195	195	12169	12161

^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.