

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de junio de 2024
Fecha de Información: 04 de junio 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\$4493 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.71%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	810,3	716,4	482,0	616,8	96,3	55,5	138
15-35	895,7	1420,0	1035,8	422,8	38,3	126,9	346
36-60	140,7	152,7	117,1	89,5	10,6	26,2	25
61-90	82,9	172,1	166,0	0,0	6,1	82,9	0
91-180	336,8	153,3	95,0	255,9	8,3	30,9	50
>180	69,5	126,8	95,8	25,9	6,0	18,6	25
Total	2335,9	2741,4	1991,7	1410,8	165,6	341,0	584

^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	6.05%	5.49%	6.01%	5.84%
15-35	6.09%	5.53%	5.72%	5.69%
36-60	5.78%	5.93%	5.71%	5.84%
61-90	–	3.88%	5.68%	5.55%
91-180	5.57%	5.52%	5.57%	5.55%
>180	5.40%	5.36%	5.07%	5.27%
Total	5.99%	5.53%	5.81%	5.71%

^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	03 – 07 jun.				10 - 14 jun.				17 - 21 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	125	153	9487	9402	74	150	7071	7907	128	151	6747	7396
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	5250	4767	0	0	4835	3303	0	0	4577	3343
Otros ^c	153	125	921	1486	150	74	634	1320	151	128	563	1098
Total	278	278	15658	15655	224	224	12540	12530	279	279	11887	11837

^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.