

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de junio de 2024
Fecha de Información: 05 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\$5562 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.83%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragruppo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	893,9	714,6	336,6	597,5	103,1	21,4	275
15-35	1552,0	2251,7	1159,9	548,6	169,8	81,5	922
36-60	167,6	140,7	50,0	50,0	40,7	67,6	50
61-90	35,1	108,4	70,6	10,0	22,7	10,1	15
91-180	550,6	236,1	153,6	215,7	17,5	269,8	65
>180	157,1	226,9	74,3	6,7	6,6	4,4	146
Total	3356,3	3678,4	1845,0	1428,6	360,4	454,8	1473

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	6.12%		6.30%	6.10%	6.16%
15-35	6.13%		5.85%	5.30%	5.85%
36-60	5.72%		5.53%	5.86%	5.68%
61-90	5.79%		4.51%	5.63%	5.05%
91-180	5.66%		5.58%	5.51%	5.55%
>180	5.20%		5.46%	5.12%	5.28%
Total	6.00%		5.82%	5.65%	5.83%

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

Sector	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	91	126	7129	7584	79	150	7269	8137	130	151	7258	7793
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	4370	3263	0	0	4862	3379	0	0	4720	3603
Otros ^c	126	91	625	1276	150	79	733	1340	151	130	577	1109
Total	217	217	12124	12123	229	229	12864	12856	281	281	12555	12505

^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.