

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de junio de 2024
Fecha de Información: 06 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\$4783 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.65%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	941,4	571,6	192,2	731,3	203,4	34,1	176,0
15-35	1222,5	1689,1	989,5	508,2	44,6	59,3	655,0
36-60	27,1	21,3	0,0	15,0	21,3	12,1	0,0
61-90	22,6	115,9	90,9	0,0	9,9	7,4	15,2
91-180	395,2	508,7	389,3	80,0	34,1	229,9	85,4
>180	102,6	101,5	95,4	97,2	1,1	0,5	5,0
Total	2711,5	3008,1	1757,2	1431,6	314,4	343,3	936,5

^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	6.22%		4.51%	5.45%	5.28%
15-35	6.20%		6.06%	5.86%	6.05%
36-60	-		6.26%	5.75%	6.07%
61-90	5.89%		5.90%	5.43%	5.86%
91-180	5.65%		5.48%	5.36%	5.46%
>180	5.43%		3.60%	4.07%	3.88%
Total	6.15%		5.50%	5.50%	5.65%

^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	32	89	4687	5036	82	150	7772	8604	133	151	7576	8008
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3104	2635	0	0	4963	3692	0	0	4916	3907
Otros ^c	89	32	155	275	150	82	928	1359	151	133	591	1119
Total	121	121	7946	7946	232	232	13663	13655	284	284	13083	13034

^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.