

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2024
Fecha de Información: 11 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\$3634 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.25%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	724,7	598,6	416,4	538,4	27,7	31,8	154,5
15-35	979,2	1326,0	804,5	390,2	0,0	171,0	418,0
36-60	112,8	142,9	102,5	2,8	5,1	74,6	35,3
61-90	9,6	19,4	9,5	0,0	9,7	9,3	0,3
91-180	73,1	153,2	150,1	43,4	3,1	29,6	0,0
>180	46,1	56,3	55,6	39,0	0,7	7,1	0,0
Total	1945,4	2296,4	1538,6	1013,8	46,2	323,5	608,1

^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	6.53%	6.37%	5.83%	6.15%
15-35	6.42%	6.48%	6.32%	6.42%
36-60	6.21%	6.19%	6.05%	6.14%
61-90	5.85%	6.07%	5.52%	5.80%
91-180	–	5.74%	5.58%	5.66%
>180	–	5.40%	5.09%	5.20%
Total	6.43%	6.38%	5.97%	6.25%

^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	10 - 14 jun.				17 - 21 jun.				24 - 28 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	86	156	8860	9333	148	150	7924	8261	196	211	6238	6909
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5242	4283	0	0	5070	4152	0	0	3438	2490
Otros ^c	156	86	978	1456	150	148	612	1143	211	196	934	1178
Total	242	242	15080	15072	298	298	13606	13556	407	407	10610	10577

^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.