

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2024
Fecha de Información: 13 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\$4387 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.33%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	645,1	844,6	623,9	298,5	31,0	156,8	189,8
15-35	1164,1	1372,4	579,7	481,2	324,7	214,9	468,0
36-60	83,7	54,0	50,0	8,0	4,0	75,7	0,0
61-90	142,5	34,2	0,0	115,8	24,0	16,4	10,3
91-180	142,7	103,6	44,7	80,2	38,6	42,2	20,3
>180	170,0	363,0	309,3	104,4	8,7	20,6	45,0
Total	2348,1	2771,8	1607,6	1088,1	430,9	526,7	733,3

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	6.72%		6.49%	5.21%	5.92%
15-35	6.72%		6.90%	6.66%	6.80%
36-60	-		6.64%	6.13%	6.34%
61-90	6.41%		5.95%	5.95%	6.00%
91-180	6.00%		5.89%	5.81%	5.86%
>180	5.41%		5.43%	5.29%	5.40%
Total	6.62%		6.54%	5.87%	6.33%

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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

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	34	95	4655	5292	165	151	8332	8610	208	212	6747	7270
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3461	2867	0	0	5378	4514	0	0	3559	2666
Otros ^c	95	34	330	279	151	165	623	1160	212	208	915	1251
Total	129	129	8446	8438	316	316	14333	14284	420	420	11221	11187

^a Cifras en millones de dólares.

^b Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

^c Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes