

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de junio de 2024
Fecha de Información: 17 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\$4051 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.50%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	537,3	463,2	135,3	467,5	272,4	14,4	55,5
15-35	802,6	1119,5	799,9	511,9	97,1	68,2	222,5
36-60	161,6	462,8	295,0	5,0	27,8	16,6	140,0
61-90	271,2	3,7	0,0	0,0	3,7	271,2	0,0
91-180	349,0	164,0	97,2	269,1	16,9	29,9	50,0
>180	27,6	166,9	133,2	4,0	23,7	13,6	10,0
Total	2149,3	2380,1	1460,5	1257,5	441,7	413,9	478,0

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%		2.33%	5.40%	3.96%
15-35	6.73%		5.85%	5.49%	5.90%
36-60	6.25%		6.24%	5.84%	6.22%
61-90	-		6.32%	5.89%	5.90%
91-180	5.90%		5.91%	5.83%	5.87%
>180	5.50%		5.49%	5.26%	5.43%
Total	6.47%		5.03%	5.60%	5.50%

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	17 – 21 jun.				24 - 28 jun.				01 - 05 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	171	153	8863	9402	218	215	7022	7548	182	84	3884	6926
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5756	4894	0	0	3701	2785	0	0	4691	1339
Otros ^c	153	171	941	1215	215	218	930	1286	84	182	212	521
Total	324	324	15560	15511	433	433	11653	11619	266	266	8787	8786

^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