

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2024
Fecha de Información: 19 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\$441 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.08%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	42,9	12,7	10,0	19,0	2,7	23,9	0,0
15-35	58,9	211,5	172,9	18,8	2,3	3,9	36,2
36-60	71,7	47,1	10,0	33,3	0,8	2,1	36,3
61-90	2,6	2,1	0,0	0,0	2,1	2,6	0,0
91-180	27,1	34,2	9,7	0,0	3,0	5,6	21,5
>180	16,0	8,2	6,0	13,8	2,2	2,2	0,0
Total	219,3	315,8	208,6	84,9	13,3	40,4	94,0

^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	–	6.54%	5.91%	6.07%
15-35	5.66%	6.60%	6.26%	6.27%
36-60	5.70%	6.48%	6.33%	5.97%
61-90	–	6.12%	5.37%	5.71%
91-180	5.76%	5.65%	5.40%	5.68%
>180	–	5.76%	5.10%	5.43%
Total	5.70%	6.52%	5.97%	6.08%

^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	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	40	108	3868	4313	226	216	7259	7797	185	84	4102	7017
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2459	1808	0	0	3800	2859	0	0	4721	1494
Otros ^c	108	40	777	982	216	226	951	1319	84	185	213	525
Total	148	148	7104	7103	442	442	12010	11975	269	269	9036	9036

^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.