

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de junio de 2024
Fecha de Información: 20 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\$3759 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.06%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	519,8	121,2	92,5	470,9	18,7	38,9	10,0
15-35	918,7	1669,3	1020,0	251,7	38,8	56,6	610,5
36-60	45,3	23,0	0,0	0,0	22,5	44,8	0,5
61-90	135,2	183,8	95,0	12,5	18,5	52,5	70,3
91-180	396,9	490,3	186,2	20,0	14,1	86,9	290,0
>180	140,3	186,5	93,7	28,0	2,8	22,3	90,0
Total	2156,3	2674,1	1487,4	783,2	115,4	301,9	1071,3

^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	6.72%	6.30%	5.18%	5.41%
15-35	6.66%	6.25%	6.53%	6.44%
36-60	6.52%	7.34%	6.15%	6.54%
61-90	6.13%	6.08%	5.93%	6.06%
91-180	5.64%	5.41%	5.58%	5.56%
>180	5.55%	5.41%	4.21%	5.32%
Total	6.25%	6.10%	5.75%	6.06%

^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	43	116	3905	4216	235	217	7319	7901	187	85	4187	7022
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2459	1879	0	0	3879	2890	0	0	4726	1568
Otros ^c	116	43	679	948	217	235	965	1338	85	187	213	535
Total	159	159	7043	7043	452	452	12163	12129	272	272	9126	9125

^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.