

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2024
Fecha de Información: 21 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\$3556 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.34%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	827,1	731,5	88,2	420,2	256,6	20,3	386,6
15-35	515,1	971,1	578,5	187,2	138,9	74,2	253,6
36-60	60,6	18,6	0,0	2,2	18,6	58,4	0,0
61-90	279,0	17,6	5,0	25,7	7,6	248,3	5,0
91-180	349,4	390,5	72,8	8,6	17,7	40,8	300,0
>180	133,4	232,4	197,7	85,4	9,7	23,0	25,0
Total	2164,6	2361,6	942,2	729,4	449,1	465,0	970,2

^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	6.79%	6.15%	6.49%	6.51%
15-35	6.75%	6.78%	6.18%	6.64%
36-60	–	5.75%	6.40%	6.25%
61-90	6.23%	6.26%	6.11%	6.12%
91-180	5.77%	5.61%	5.55%	5.72%
>180	5.66%	5.63%	5.47%	5.59%
Total	6.43%	6.39%	6.20%	6.34%

^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

Sector	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	14	63	430	545	240	221	8004	8520	190	86	4344	7152
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	339	237	0	0	3942	3260	0	0	4746	1614
Otros ^c	63	14	102	88	221	240	1218	1351	86	190	213	536
Total	77	77	871	870	461	461	13164	13131	276	276	9303	9302

^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.