

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2024
Fecha de Información: 25 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\$4322 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.05%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	794,2	581,4	159,5	561,1	230,0	41,1	192,0
15-35	583,7	1080,3	776,5	311,2	64,8	33,4	239,0
36-60	203,8	314,6	164,0	71,0	41,6	23,9	109,0
61-90	322,7	180,1	50,0	61,0	79,7	211,3	50,4
91-180	439,5	477,0	90,7	42,0	16,2	27,6	370,0
>180	175,5	149,6	119,5	142,2	10,1	13,3	20,0
Total	2519,5	2783,1	1360,2	1188,5	442,5	350,6	980,4

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	6.52%		4.51%	6.53%	5.83%
15-35	6.48%		6.51%	6.47%	6.50%
36-60	6.11%		6.27%	6.19%	6.20%
61-90	5.68%		5.99%	5.62%	5.75%
91-180	5.75%		5.79%	5.65%	5.76%
>180	5.52%		5.49%	5.29%	5.41%
Total	6.11%		5.88%	6.25%	6.05%

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	24 – 28 jun.				01 - 05 jul.				08 - 12 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	228	201	7625	8217	198	98	4890	7519	121	109	6956	9183
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3878	3166	0	0	4748	2003	0	0	5207	2525
Otros ^c	201	228	1166	1251	98	198	423	538	109	121	1012	1378
Total	429	429	12669	12634	296	296	10061	10060	230	230	13175	13086

^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