

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2024
Fecha de Información: 26 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\$4061 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.03%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	717,5	448,8	265,0	454,2	12,8	92,3	171
15-35	1414,8	1262,1	456,5	554,6	24,6	79,1	781
36-60	235,0	427,2	243,5	0,0	13,7	65,0	170
61-90	98,3	173,9	97,0	40,0	26,8	8,3	50
91-180	165,0	137,8	60,0	73,1	12,8	26,9	65
>180	69,0	178,4	134,3	31,7	14,2	7,3	30
Total	2699,6	2628,2	1256,3	1153,6	105,0	278,9	1267

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	6.40%	4.85%	6.12%	5.87%
15-35	6.31%	6.35%	5.68%	6.15%
36-60	6.27%	6.15%	6.09%	6.19%
61-90	6.06%	5.83%	6.00%	5.93%
91-180	5.78%	5.75%	5.77%	5.77%
>180	5.46%	5.56%	5.33%	5.52%
Total	6.26%	5.88%	5.91%	6.03%

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.

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	220	148	6474	6750	200	96	5293	7569	128	104	7139	9371
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3171	2968	0	0	4758	2366	0	0	5358	2604
Otros ^c	148	220	839	745	96	200	423	538	104	128	1031	1464
Total	368	368	10484	10463	296	296	10474	10473	232	232	13528	13439

^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