

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de junio de 2024
Fecha de Información: 07 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\$3272 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.01%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	692,7	699,4	270,5	287,7	46,2	22,4	382,6
15-35	942,1	1238,4	528,8	301,9	120,6	51,2	589,0
36-60	108,2	274,9	190,0	0,0	14,9	38,2	70,0
61-90	57,3	55,2	32,5	34,7	12,7	12,6	10,0
91-180	62,5	96,6	50,3	0,0	36,3	52,5	10,0
>180	55,1	51,2	49,3	52,2	2,0	2,9	0,0
Total	1918,0	2415,6	1121,3	676,6	232,7	179,8	1061,6

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.42%		5.23%	6.32%	6.17%
15-35	6.35%		6.13%	6.15%	6.23%
36-60	6.29%		4.10%	6.09%	4.84%
61-90	5.99%		6.10%	5.71%	6.01%
91-180	5.67%		5.69%	5.50%	5.61%
>180	—		4.71%	5.18%	4.99%
Total	6.36%		5.60%	6.15%	6.01%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	03 - 07 jun.				10 - 14 jun.				17 - 21 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	12	57	1103	1311	85	156	8233	9033	140	150	7801	8218
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	803	546	0	0	5095	3879	0	0	5059	4070
Otros ^c	57	12	45	94	156	85	956	1364	150	140	604	1126
Total	69	69	1951	1951	241	241	14284	14276	290	290	13464	13414

^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.