

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de junio de 2024
Fecha de Información: 12 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\$4052 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.37%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	668,7	472,4	370,0	520,4	9,5	55,4	93,0
15-35	1002,4	1454,9	1037,5	467,0	47,9	165,8	369,5
36-60	60,1	108,6	100,0	6,4	8,5	53,6	0,1
61-90	65,8	97,2	80,0	23,9	7,2	31,9	10,0
91-180	71,3	243,1	191,2	18,7	11,4	12,1	40,5
>180	133,1	232,9	173,4	70,1	14,5	18,0	45,0
Total	2001,4	2609,2	1952,1	1106,5	98,9	336,8	558,1

^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	6.70%		6.55%	6.00%	6.27%
15-35	6.56%		6.64%	6.32%	6.55%
36-60	5.37%		6.48%	6.08%	6.13%
61-90	6.14%		6.14%	5.80%	6.04%
91-180	5.78%		5.60%	5.31%	5.63%
>180	5.59%		5.56%	5.12%	5.48%
Total	6.44%		6.53%	6.11%	6.37%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	10 – 14 jun.				17 - 21 jun.				24 - 28 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	56	133	7696	8236	156	151	8023	8334	202	212	6491	7037
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4645	3898	0	0	5111	4218	0	0	3525	2643
Otros ^c	133	56	810	1009	151	156	618	1151	212	202	907	1210
Total	189	189	13151	13143	307	307	13752	13703	414	414	10923	10890

^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.