

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de julio de 2024
Fecha de Información: 27 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\$2925 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.57%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	488,8	274,7	110,6	289,6	39,0	74,3	125,0
15-35	1040,5	1224,0	572,3	370,0	55,8	74,5	596,0
36-60	95,3	117,1	35,0	1,0	6,9	19,1	75,2
61-90	71,6	112,1	70,0	0,0	11,6	41,1	30,5
91-180	78,1	125,1	36,8	20,0	58,3	28,1	30,0
>180	135,6	113,8	15,1	25,0	3,7	15,6	95,0
Total	1909,9	1966,9	839,9	705,6	175,3	252,6	951,7

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	6.10%	6.18%	4.96%	5.65%
15-35	6.15%	5.17%	4.84%	5.49%
36-60	6.12%	6.19%	5.86%	6.10%
61-90	5.85%	5.73%	5.77%	5.76%
91-180	5.64%	5.60%	5.56%	5.60%
>180	5.39%	5.29%	4.60%	5.28%
Total	6.04%	5.50%	5.00%	5.57%

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	153	108	2107	2113	205	95	5384	7615	130	107	7350	9630
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	730	630	0	0	4770	2415	0	0	5475	2636
Otros ^c	108	153	474	568	95	205	444	568	107	130	1048	1518
Total	261	261	3311	3311	300	300	10598	10598	237	237	13873	13784

^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