

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de julio de 2024
Fecha de Información: 28 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\$2756 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.26%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	598,7	73,5	11,8	524,4	6,2	18,8	55,5
15-35	712,8	1061,1	758,8	275,8	59,8	194,4	242,5
36-60	8,9	97,0	70,0	0,0	27,0	8,9	0,0
61-90	48,2	145,5	39,1	41,9	106,4	6,2	0,0
91-180	4,2	108,8	96,6	0,0	11,7	3,8	0,5
>180	102,8	113,0	89,7	81,9	3,3	0,9	20,0
Total	1475,5	1598,9	1066,1	924,0	214,4	233,0	318,5

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	6.27%		5.60%	6.85%	6.75%
15-35	6.20%		6.22%	6.04%	6.17%
36-60	-		6.08%	5.68%	5.98%
61-90	-		5.92%	5.62%	5.90%
91-180	5.56%		5.84%	5.52%	5.75%
>180	5.43%		6.12%	5.29%	5.40%
Total	6.16%		6.16%	6.40%	6.26%

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	127	45	787	911	209	103	5919	7652	136	109	7471	9656
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	381	233	0	0	4770	2908	0	0	5476	2730
Otros ^c	45	127	224	248	103	209	445	574	109	136	1052	1524
Total	172	172	1392	1392	312	312	11134	11134	245	245	13999	13910

^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