

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de julio de 2024
Fecha de Información: 02 de julio 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\$3774 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.81%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	830,9	498,3	327,9	664,5	22,8	18,7	147,7
15-35	633,1	970,6	642,3	237,5	24,6	91,9	303,7
36-60	153,5	19,7	1,0	0,0	18,8	153,5	0,0
61-90	312,9	507,0	270,0	81,0	6,6	1,5	230,4
91-180	275,0	260,1	55,3	22,1	4,8	52,9	200,0
>180	81,4	113,3	112,6	81,4	0,6	0,0	0,0
Total	2286,7	2369,0	1409,1	1086,5	78,1	318,5	881,8

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	6.20%	6.42%	4.83%	5.26%
15-35	6.26%	6.20%	6.12%	6.20%
36-60	–	6.04%	5.65%	5.69%
61-90	5.73%	5.76%	5.76%	5.73%
91-180	5.66%	5.73%	5.50%	5.62%
>180	–	5.35%	–	5.35%
Total	5.98%	6.18%	5.36%	5.81%

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	01 – 05 jul.				08 - 12 jul.				15 - 19 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	210	101	6471	8087	142	120	7952	9817	165	129	7143	7325
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5060	3221	0	0	5478	3056	0	0	3949	2491
Otros ^c	101	210	471	694	120	142	1068	1536	129	165	612	1866
Total	311	311	12002	12002	262	262	14498	14409	294	294	11704	11682

^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